

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／債券	
信託期間	2032年5月10日まで（2012年6月1日設定）	
運用方針	マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券に投資を行い、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。なお、インフラ関連企業とは、公益、通信、エネルギーおよび運輸等の日常生活に必要不可欠なサービスを提供する企業をいいます。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の運用にあたっては、マッコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。	
主要運用対象	ベビーファンド	マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	マザーファンド	世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	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。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ことがあります。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。なお、第2計算期末までの間は、収益の分配は行いません。	

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

運用報告書（全体版）

三菱UFJ／マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド 〈為替ヘッジあり〉（毎月決算型）

愛称：世界のいしずえ



第144期（決算日：2024年6月10日）
 第145期（決算日：2024年7月10日）
 第146期（決算日：2024年8月13日）
 第147期（決算日：2024年9月10日）
 第148期（決算日：2024年10月10日）
 第149期（決算日：2024年11月11日）



受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。さて、お手持ちの「三菱UFJ／マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド〈為替ヘッジあり〉（毎月決算型）」は、去る11月11日に第149期の決算を行いましたので、法令に基づいて第144期～第149期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJアセットマネジメント

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
フリーダイヤル

0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

ファンドマネージャーのコメント

当期間（過去6ヶ月）の運用で主眼においたポイントをご説明させていただきます。

■運用のポイント

期間の初めから2024年9月頃にかけては、米連邦準備制度理事会（FRB）による利下げ観測の高まり等を背景に米金利は低下しました。その後、米雇用統計などの経済指標の堅調な結果を受けて、米国を中心に利下げ観測が後退したこと等から上昇に転じる局面があったものの、当期間を通じてみると米金利は低下しました。当ファンドのデュレーション（平均回収期間や金利感応度）は市場対比で長めの水準から徐々に引き下げられ、8月以降は中立水準を維持しました。インフラ債券市況のスプレッド（国債との利回り格差）は縮小しました。格付け別にみると、BBB格銘柄が好調に推移しました。セクター別では通信セクターを愛好しております。

■運用環境の見通しと今後の運用方針

米大統領選の結果と予想される共和党の圧勝が足もとで最大の関心事となっています。法人税引き下げや選択的な財政支出などの政策が実施されることによる財政赤字の拡大によって、短期的に米金利に一定の上昇圧力がかかる可能性があります。景気減速やディス

インフレの継続、FRBの段階的な緩和政策などにより、今後数カ月間は引き続き米金利は低下していくと想定しています。投資家の積極的な姿勢や金融緩和の恩恵から、市場のボラティリティーは相対的に低い水準が維持され、法人税の引き下げや規制緩和の見通しは、企業の収益を押し上げる可能性を高めると見込まれています。デュレーションについては、適宜債券先物を活用しつつ、状況に応じて機動的に対応します。



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



シニア・ポートフォリオマネージャー
ネイサン・ブーン

上記は、マコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・リミテッドの資料を基に、三菱UFJアセットマネジメントが作成したものです。

本資料の表記にあたって

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

○最近30期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			(参考指数) 合成インデックス (円ヘッジベース)		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
		税込 分配	み 騰	期 騰	中 率	期 騰			
	円	円	円	%	円	%	%	%	百万円
120期(2022年6月10日)	7,177		20	1.3	11,412	1.1	95.8	0.7	8,877
121期(2022年7月11日)	6,980		20	△2.5	11,154	△2.3	95.2	0.3	8,913
122期(2022年8月10日)	7,156		20	2.8	11,460	2.8	95.5	1.5	9,234
123期(2022年9月12日)	6,819		20	△4.4	10,980	△4.2	93.3	1.8	9,056
124期(2022年10月11日)	6,400		20	△5.9	10,393	△5.4	93.6	3.7	9,186
125期(2022年11月10日)	6,300		20	△1.3	10,202	△1.8	93.5	2.2	9,430
126期(2022年12月12日)	6,746		20	7.4	10,937	7.2	95.6	△0.2	10,461
127期(2023年1月10日)	6,727		20	0.0	10,950	0.1	94.7	△1.2	11,147
128期(2023年2月10日)	6,690		20	△0.3	10,922	△0.3	95.8	△2.1	11,935
129期(2023年3月10日)	6,464		20	△3.1	10,579	△3.1	95.5	△0.4	12,014
130期(2023年4月10日)	6,685		20	3.7	10,970	3.7	95.6	0.3	12,738
131期(2023年5月10日)	6,525		20	△2.1	10,753	△2.0	94.6	△0.2	12,775
132期(2023年6月12日)	6,415		20	△1.4	10,609	△1.3	96.3	△0.4	13,155
133期(2023年7月10日)	6,308		20	△1.4	10,490	△1.1	94.5	0.6	13,537
134期(2023年8月10日)	6,299		20	0.2	10,513	0.2	96.8	0.7	14,075
135期(2023年9月11日)	6,183		20	△1.5	10,363	△1.4	95.8	1.6	14,098
136期(2023年10月10日)	5,946		20	△3.5	9,912	△4.3	95.0	1.1	13,535
137期(2023年11月10日)	5,952		20	0.4	10,055	1.4	96.3	0.4	13,597
138期(2023年12月11日)	6,242		20	5.2	10,567	5.1	95.3	△0.6	13,950
139期(2024年1月10日)	6,323		20	1.6	10,748	1.7	96.6	△1.2	14,207
140期(2024年2月13日)	6,221		20	△1.3	10,616	△1.2	96.0	△1.4	14,112
141期(2024年3月11日)	6,230		20	0.5	10,672	0.5	94.1	△0.9	14,045
142期(2024年4月10日)	6,132		20	△1.3	10,547	△1.2	96.4	△0.2	13,615
143期(2024年5月10日)	6,049		20	△1.0	10,432	△1.1	96.8	0.2	13,249
144期(2024年6月10日)	6,037		20	0.1	10,462	0.3	97.6	0.4	13,088
145期(2024年7月10日)	6,063		10	0.6	10,528	0.6	96.0	0.3	13,032
146期(2024年8月13日)	6,138		10	1.4	10,695	1.6	95.9	△2.0	13,080
147期(2024年9月10日)	6,251		10	2.0	10,929	2.2	96.1	△1.6	13,273
148期(2024年10月10日)	6,146		10	△1.5	10,757	△1.6	97.2	△1.9	13,764
149期(2024年11月11日)	6,086		10	△0.8	10,655	△0.9	96.2	△1.1	13,583

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。

(注) 参考指数は、ブルームバーグ米国総合社債インデックス、インフラ関連業種(公益、通信、エネルギー、運輸)の合成インデックス(円ヘッジベース)です。

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

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

○当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		(参 考 指 数)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落 率	騰 落 率	合 成 イ ン	デ ッ ク ス		
第144期	(期 首) 2024年5月10日	円 6,049	% -	(円ヘッジベース) 10,432	% -	% 96.8	% 0.2
	5月末	6,010	△0.6	10,373	△0.6	96.7	△0.2
	(期 末) 2024年6月10日	6,057	0.1	10,462	0.3	97.6	0.4
第145期	(期 首) 2024年6月10日	6,037	-	10,462	-	97.6	0.4
	6月末	6,063	0.4	10,511	0.5	97.0	△0.2
	(期 末) 2024年7月10日	6,073	0.6	10,528	0.6	96.0	0.3
第146期	(期 首) 2024年7月10日	6,063	-	10,528	-	96.0	0.3
	7月末	6,093	0.5	10,586	0.6	94.1	0.1
	(期 末) 2024年8月13日	6,148	1.4	10,695	1.6	95.9	△2.0
第147期	(期 首) 2024年8月13日	6,138	-	10,695	-	95.9	△2.0
	8月末	6,198	1.0	10,805	1.0	97.0	△2.0
	(期 末) 2024年9月10日	6,261	2.0	10,929	2.2	96.1	△1.6
第148期	(期 首) 2024年9月10日	6,251	-	10,929	-	96.1	△1.6
	9月末	6,260	0.1	10,950	0.2	94.7	△1.7
	(期 末) 2024年10月10日	6,156	△1.5	10,757	△1.6	97.2	△1.9
第149期	(期 首) 2024年10月10日	6,146	-	10,757	-	97.2	△1.9
	10月末	6,054	△1.5	10,577	△1.7	96.3	△1.4
	(期 末) 2024年11月11日	6,096	△0.8	10,655	△0.9	96.2	△1.1

(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。

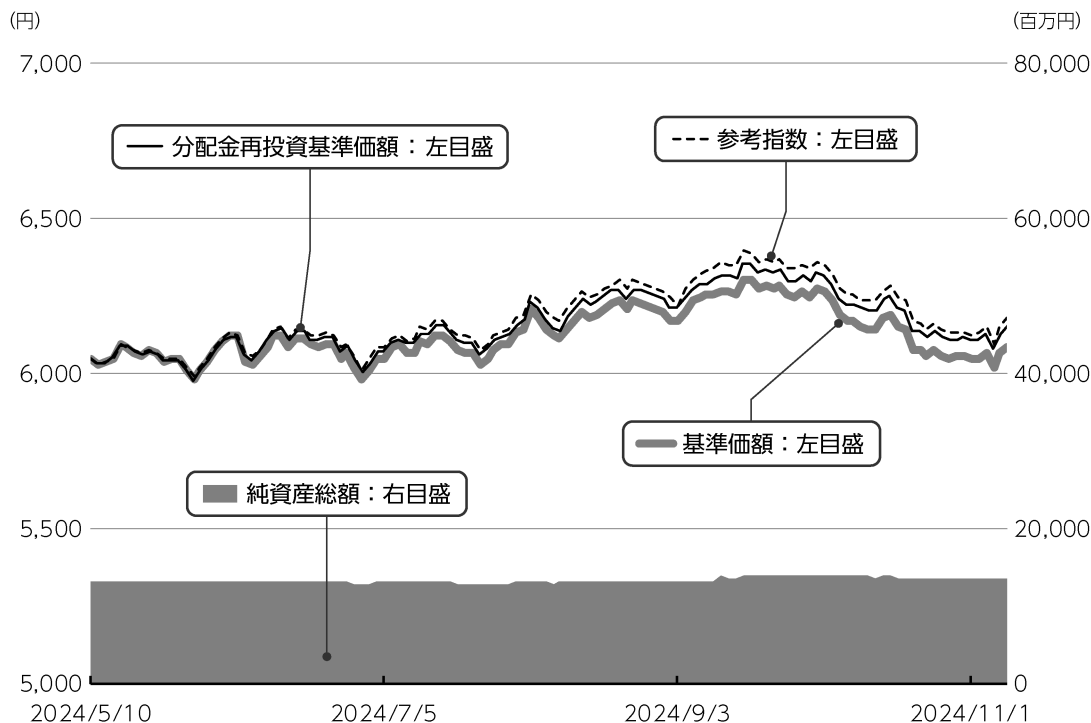
(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

運用経過

第144期～第149期：2024年5月11日～2024年11月11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144期首	6,049円
第149期末	6,086円
既払分配金	70円
騰落率	1.8%
(分配金再投資ベース)	

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
 ※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ1.8%（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

米金利の低下やスプレッドの縮小等を受けてインフラ債券市況が上昇したこと等。

下落要因

米ドル売り円買いの為替ヘッジのコスト等。

第144期～第149期：2024年5月11日～2024年11月11日

投資環境について

▶ 債券市況

インフラ債券市況は上昇しました。

期間の初めから2024年9月頃にかけては、米連邦準備制度理事会（FRB）による利下げ観測の高まり等を背景に米金利は低下しました。その後、米雇用統計などの経済指標の堅調な結果を受けて、米国を中心に利下げ観測が後退したこと

等から上昇に転じる局面があったものの、当期間を通じてみると米金利は低下しました。そのような環境下、米金利が低下したことや堅調な米国経済等を背景にスプレッド（国債との利回り格差）が縮小したこと等がプラスとなり、インフラ債券市況は上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

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

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

▶ マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド

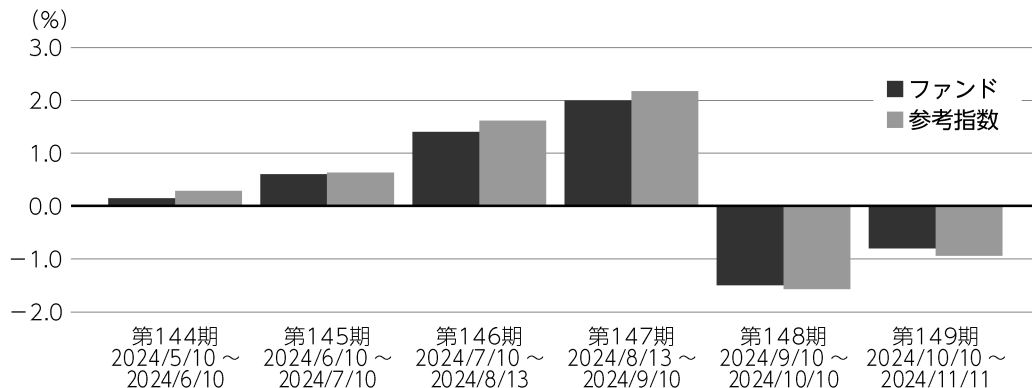
世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を高位に組み入れる運用を行いました。

2024年10月末時点において、デュレーション（平均回収期間や金利感応度）については市場対比で中立としました。格付別では投資適格の中でも相対的に利回りが高いBBB格の組入比率を市場対比多めとしました。セクター別では運輸を市場対比少なめの配分としました。

第144期～第149期：2024/5/11～2024/11/11

当該投資信託のベンチマークとの差異について

基準価額と参考指数の対比（騰落率）



※ファンドの騰落率は分配金込みで計算しています。

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。上記のグラフは当ファンド（ベビーファンド）の基準価額と参考指数の騰落率との対比です。

参考指数は合成インデックス（円ヘッジベース）です。

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144期 2024年5月11日~ 2024年6月10日	第145期 2024年6月11日~ 2024年7月10日	第146期 2024年7月11日~ 2024年8月13日	第147期 2024年8月14日~ 2024年9月10日	第148期 2024年9月11日~ 2024年10月10日	第149期 2024年10月11日~ 2024年11月11日
当期分配金 (対基準価額比率)	20 (0.330%)	10 (0.165%)	10 (0.163%)	10 (0.160%)	10 (0.162%)	10 (0.164%)
当期の収益	18	10	10	10	10	10
当期の収益以外	1	-	-	-	-	-
翌期繰越分配対象額	619	630	645	657	665	674

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針 （作成対象期間末での見解です。）

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

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

▶ マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド

引き続き主要中央銀行による金融政策や米国等の財政政策の動向等を注視しています。そのような環境下、銘柄選択については、格付け動向に注視しながらクオリティの高い銘柄を中心に投資を行う方針です。デュレーションについては、適宜債券先物を活用しつつ、状況に応じて機動的に対応します。

2024年5月11日～2024年11月11日

1万口当たりの費用明細

項目	第144期～第149期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	41	0.669	(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)	(23)	(0.368)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(17)	(0.279)	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)	(0.022)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b) 売買委託手数料 = 作成期中の売買委託手数料 ÷ 作成期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(c) その他費用	0	0.006	(c) その他費用 = 作成期中のその他費用 ÷ 作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(0)	(0.004)	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	41	0.676	

作成期中の平均基準価額は、6,126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。

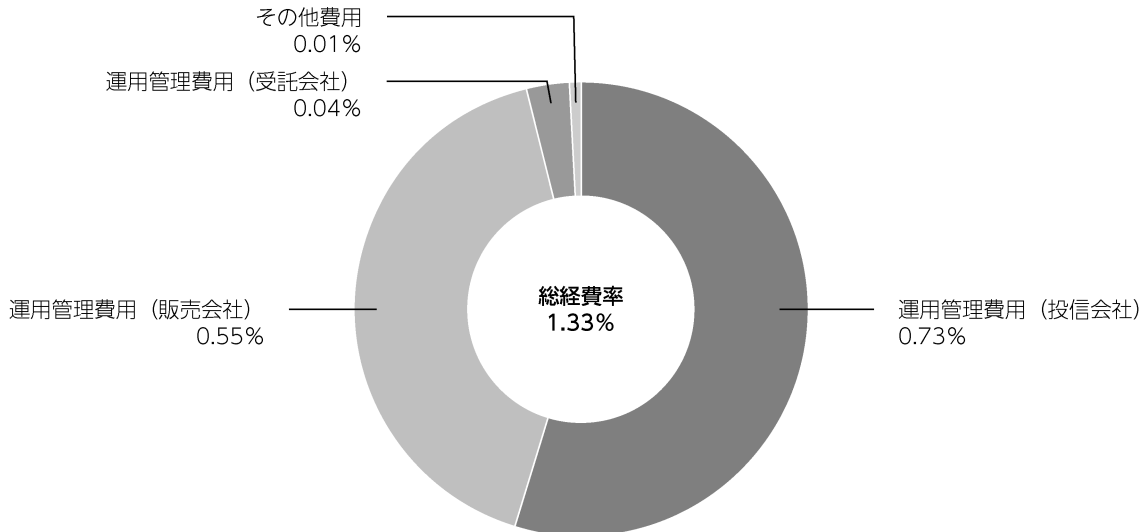
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

（参考情報）

■ 総経費率

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.33%**です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

○売買及び取引の状況

（2024年5月11日～2024年11月11日）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘	柄	第144期～第149期			
		設		解	
		口	金	口	金
		数	額	数	額
		千口	千円	千口	千円
マコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド		795,312	2,068,000	855,340	2,289,000

○利害関係人との取引状況等

（2024年5月11日～2024年11月11日）

利害関係人との取引状況

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

区	分	第144期～第149期					
		買付額等			売付額等		
		A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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		129,820	89,994	69.3	129,668	89,956	69.4

<マコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド>

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

（2024年11月11日現在）

親投資信託残高

銘	柄	第143期末	第149期末	
		口	口	評価額
		数	数	額
		千口	千口	千円
マコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド		4,990,533	4,930,505	13,458,307

○投資信託財産の構成

(2024年11月11日現在)

項 目	第149期末	
	評 価 額	比 率
マコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド	千円 13,458,307	% 97.8
コール・ローン等、その他	301,830	2.2
投資信託財産総額	13,760,137	100.0

(注) マコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンドにおいて、作成期末における外貨建純資産 (243,041,367千円) の投資信託財産総額 (243,538,422千円) に対する比率は99.8%です。

(注) 外貨建資産は、作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、作成期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=153.14円			
------------------	--	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第144期末	第145期末	第146期末	第147期末	第148期末	第149期末
	2024年6月10日現在	2024年7月10日現在	2024年8月13日現在	2024年9月10日現在	2024年10月10日現在	2024年11月11日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	25,877,471,169	25,697,818,755	25,776,538,218	26,120,568,555	27,376,001,944	26,787,444,204
コール・ローン等	97,184,668	372,117,042	590,377,044	234,509,270	696,873,252	301,828,737
マコーリーグローバル・インフラ債券マザーファンド(信託)	13,096,148,543	12,875,221,520	12,884,991,737	13,087,889,688	13,684,129,011	13,458,307,351
未収入金	12,684,137,790	12,450,479,557	12,301,165,995	12,798,168,228	12,994,995,587	13,027,306,348
未収利息	168	636	3,442	1,369	4,094	1,768
(B) 負債	12,788,903,762	12,664,884,702	12,696,396,403	12,847,031,557	13,611,656,268	13,203,736,189
未払金	12,705,315,265	12,621,463,380	12,626,333,134	12,801,862,316	13,563,730,896	13,156,919,120
未払収益分配金	43,360,907	21,497,163	21,309,767	21,234,521	22,397,024	22,320,705
未払解約金	25,363,396	7,664,736	32,684,061	10,539,687	10,497,569	8,688,514
未払信託報酬	14,812,360	14,209,701	16,013,405	13,348,324	14,978,363	15,752,724
その他未払費用	51,834	49,722	56,036	46,709	52,416	55,126
(C) 純資産総額(A-B)	13,088,567,407	13,032,934,053	13,080,141,815	13,273,536,998	13,764,345,676	13,583,708,015
元本	21,680,453,818	21,497,163,548	21,309,767,877	21,234,521,731	22,397,024,493	22,320,705,472
次期繰越損益金	△ 8,591,886,411	△ 8,464,229,495	△ 8,229,626,062	△ 7,960,984,733	△ 8,632,678,817	△ 8,736,997,457
(D) 受益権総口数	21,680,453,818口	21,497,163,548口	21,309,767,877口	21,234,521,731口	22,397,024,493口	22,320,705,472口
1万口当たり基準価額(C/D)	6.037円	6.063円	6.138円	6.251円	6.146円	6.086円

○損益の状況

項 目	第144期	第145期	第146期	第147期	第148期	第149期
	2024年5月11日～ 2024年6月10日	2024年6月11日～ 2024年7月10日	2024年7月11日～ 2024年8月13日	2024年8月14日～ 2024年9月10日	2024年9月11日～ 2024年10月10日	2024年10月11日～ 2024年11月11日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	14,244	14,496	44,729	58,752	62,204	115,290
受取利息	14,244	14,496	44,729	58,752	62,204	115,290
(B) 有価証券売買損益	31,929,918	90,466,973	197,353,936	272,674,644	△ 198,860,585	△ 94,945,329
売買益	308,175,177	539,156,659	1,398,766,267	328,175,480	640,240,936	842,543,782
売買損	△ 276,245,259	△ 448,689,686	△ 1,201,412,331	△ 55,500,836	△ 839,101,521	△ 937,489,111
(C) 信託報酬等	△ 14,883,004	△ 14,269,576	△ 16,086,338	△ 13,409,516	△ 15,051,090	△ 15,807,850
(D) 当期損益金 (A+B+C)	17,061,158	76,211,893	181,312,327	259,323,880	△ 213,849,471	△ 110,637,889
(E) 前期繰越損益金	△ 3,061,109,478	△ 3,044,900,992	△ 2,933,722,019	△ 2,734,194,162	△ 2,472,855,285	△ 2,686,088,037
(F) 追加信託差損益金	△ 5,504,477,184	△ 5,474,043,233	△ 5,455,906,603	△ 5,464,879,930	△ 5,923,577,037	△ 5,917,950,826
(配当等相当額)	(1,268,351,586)	(1,258,237,348)	(1,248,395,091)	(1,245,628,200)	(1,323,722,377)	(1,322,061,553)
(売買損益相当額)	(△ 6,772,828,770)	(△ 6,732,280,581)	(△ 6,704,301,694)	(△ 6,710,508,130)	(△ 7,247,299,414)	(△ 7,240,012,379)
(G) 計 (D+E+F)	△ 8,548,525,504	△ 8,442,732,332	△ 8,208,316,295	△ 7,939,750,212	△ 8,610,281,793	△ 8,714,676,752
(H) 収益分配金	△ 43,360,907	△ 21,497,163	△ 21,309,767	△ 21,234,521	△ 22,397,024	△ 22,320,705
次期繰越損益金 (G+H)	△ 8,591,886,411	△ 8,464,229,495	△ 8,229,626,062	△ 7,960,984,733	△ 8,632,678,817	△ 8,736,997,457
追加信託差損益金	△ 5,504,477,184	△ 5,474,043,233	△ 5,455,906,603	△ 5,464,879,930	△ 5,923,577,037	△ 5,917,950,826
(配当等相当額)	(1,268,567,898)	(1,258,385,814)	(1,248,679,049)	(1,245,914,099)	(1,325,740,184)	(1,322,248,586)
(売買損益相当額)	(△ 6,773,045,082)	(△ 6,732,429,047)	(△ 6,704,585,652)	(△ 6,710,794,029)	(△ 7,249,317,221)	(△ 7,240,199,412)
分配準備積立金	74,190,800	96,230,889	126,758,862	149,827,315	164,846,308	183,720,832
繰越損益金	△ 3,161,600,027	△ 3,086,417,151	△ 2,900,478,321	△ 2,645,932,118	△ 2,873,948,088	△ 3,002,767,463

(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 21,903,895,413円
 作成期中追加設定元本額 2,177,293,645円
 作成期中一部解約元本額 1,760,483,586円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.6086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8,736,997,457円です。
- ③ 分配金の計算過程

項 目	2024年5月11日～ 2024年6月10日	2024年6月11日～ 2024年7月10日	2024年7月11日～ 2024年8月13日	2024年8月14日～ 2024年9月10日	2024年9月11日～ 2024年10月10日	2024年10月11日～ 2024年11月11日
費用控除後の配当等収益額	40,492,397円	44,558,729円	53,654,881円	46,109,278円	38,811,562円	42,595,597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	－円	－円	－円	－円	－円
収益調整金額	1,268,567,898円	1,258,385,814円	1,248,679,049円	1,245,914,099円	1,325,740,184円	1,322,248,586円
分配準備積立金額	77,059,310円	73,169,323円	94,413,748円	124,952,558円	148,431,770円	163,445,940円
当ファンドの分配対象収益額	1,386,119,605円	1,376,113,866円	1,396,747,678円	1,416,975,935円	1,512,983,516円	1,528,290,123円
1万円当たり収益分配対象額	639円	640円	655円	667円	675円	684円
1万円当たり分配金額	20円	10円	10円	10円	10円	10円
収益分配金金額	43,360,907円	21,497,163円	21,309,767円	21,234,521円	22,397,024円	22,320,705円

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

○分配金のお知らせ

	第144期	第145期	第146期	第147期	第148期	第149期
1万口当たり分配金（税込み）	20円	10円	10円	10円	10円	10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】

東京証券取引所の取引時間の延伸に伴い、申込締切時間の変更を行いました。詳細は、当社ホームページ（<https://www.am.mufg.jp/>）から当該ファンドページの目論見書をご覧ください。

(2024年11月5日)

マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド

《第12期》決算日2024年5月10日

[計算期間：2023年5月11日～2024年5月10日]

「マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド」は、5月10日に第12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12期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。なお、インフラ関連企業とは、公益、通信、エネルギーおよび運輸等の日常生活に必要な不可欠なサービスを提供する企業をいいます。債券への投資にあたっては、マクロ要因分析、業種分析、個別企業の財務・業務分析等の信用リスク分析に基づき、銘柄選定を行います。 組入公社債の格付けは、原則として取得時においてBBB一格相当以上の格付を有しているものに限ります。 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。また、ファンドの流動性等を勘案して、一部、米国公債等に投資する場合があります。 債券等の運用にあたっては、マッコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
主 要 運 用 対 象	世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(参考指数) 合成インデックス (円換算ベース)		債組入比率	債券先物比率	純資産額
	騰落	率	騰落	率			
8期(2020年5月11日)	円	%			%	%	百万円
	18,784	4.5	18,807	4.3	98.5	△1.6	64,266
9期(2021年5月10日)	20,440	8.8	20,539	9.2	98.2	△4.8	93,087
10期(2022年5月10日)	21,114	3.3	21,333	3.9	97.7	△0.8	100,296
11期(2023年5月10日)	22,071	4.5	22,226	4.2	97.2	△0.2	125,328
12期(2024年5月10日)	26,300	19.2	26,517	19.3	97.7	0.2	223,618

(注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。

(注) 参考指数は、ブルームバーグ米国総合社債インデックス、インフラ関連業種(公益、通信、エネルギー、運輸)の合成インデックス(円換算ベース)です。

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		(参考指数) 合成インデックス (円換算ベース)		債組入比率	債券先物比率
	騰落	率	騰落	率		
(期首)	円	%			%	%
2023年5月10日	22,071	—	22,226	—	97.2	△0.2
5月末	22,676	2.7	22,824	2.7	96.2	△0.6
6月末	23,536	6.6	23,736	6.8	96.6	△1.0
7月末	23,036	4.4	23,208	4.4	97.2	0.7
8月末	23,627	7.0	23,830	7.2	95.9	0.9
9月末	23,460	6.3	23,686	6.6	96.2	1.4
10月末	22,914	3.8	23,149	4.2	95.9	0.9
11月末	24,229	9.8	24,425	9.9	97.0	△0.8
12月末	24,503	11.0	24,688	11.1	97.4	△1.4
2024年1月末	25,266	14.5	25,463	14.6	97.1	△1.3
2月末	25,369	14.9	25,578	15.1	97.4	△1.5
3月末	25,899	17.3	26,134	17.6	97.8	△1.8
4月末	26,132	18.4	26,357	18.6	97.7	△0.2
(期末)						
2024年5月10日	26,300	19.2	26,517	19.3	97.7	0.2

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

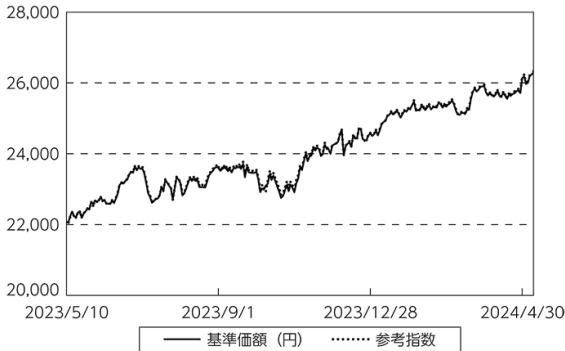
○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ19.2%の上昇となりました。

基準価額等の推移



(注) 参考指数は期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

- ・スプレッド（国債との利回り格差）の縮小等からインフラ債券市況が上昇したこと。
- ・米ドルが対円で上昇したこと等。

●投資環境について

◎債券市況

- ・インフラ債券市況は上昇しました。
- ・期間の初めから2023年10月頃にかけて米連邦準備制度理事会（FRB）による金融引き締め政策の長期化等を背景に米金利は上昇しました。その後、インフレの落ち着き等からFRBの早

期利下げ期待等を背景に米金利が低下する局面があったものの、当期間を通じてみると米金利は上昇しました。そのような環境下、米金利が上昇したことがマイナスとなったものの、堅調な米国経済等を背景にスプレッド（国債との利回り格差）が縮小したこと等がプラスとなり、インフラ債券市況は上昇しました。

◎為替市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を高位に組み入れる運用を行いました。
- ・2024年4月末時点において、デュレーション（平均回収期間や金利感応度）については市場対比で長めとしました。格付別では投資適格の中でも相対的に利回りが高いBBB格の組入比率を市場対比多めとしました。セクター別では通信を市場対比多めの配分としました。

○今後の運用方針

- ・根強いインフレ圧力が確認される中、主要中央銀行による金融政策の動向等を注視しています。そのような環境下、銘柄選択については、格付け動向に注視しながらクオリティの高い銘柄を中心に投資を行う方針です。デュレーション（平均回収期間や金利感応度）については、適宜債券先物を活用しつつ、状況に応じて機動的に対応します。

○1万口当たりの費用明細

(2023年5月11日～2024年5月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 1 (1)	% 0.003 (0.003)	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	3 (3) (0)	0.011 (0.011) (0.000)	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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
合 計	4	0.014	
期中の平均基準価額は、24,070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

(2023年5月11日～2024年5月10日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	社債券	千アメリカドル 771,704	千アメリカドル 255,802 (2,410)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	債券先物取引	百万円 95,500	百万円 105,664	百万円 64,084	百万円 75,348

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

○利害関係人との取引状況等

(2023年5月11日～2024年5月10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	$\frac{D}{C}$ %
為替直物取引	百万円 69,774	百万円 16,449	23.6	百万円 2,983	百万円 1,145	38.4

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

(2024年5月10日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 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 1,550,396	千アメリカドル 1,403,513	千円 218,526,998	% 97.7	% —	% 75.6	% 16.2	% 5.9
合 計	1,550,396	1,403,513	218,526,998	97.7	—	75.6	16.2	5.9

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利率	当 額面金額	期 評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	普通社債券					
	0.95 NISOURCE INC 250815	0.95	2,000	1,890	294,392	2025/8/15
	1.75 XCEL ENERGY 270315	1.75	2,000	1,811	282,109	2027/3/15
	2 KINDER MORGAN I 310215	2.0	3,800	3,089	481,026	2031/2/15
	2.25 AT&T INC 320201	2.25	2,300	1,852	288,423	2032/2/1
	2.25 NEXTERA ENER 300601	2.25	3,000	2,539	395,465	2030/6/1
	2.3 AMERICAN ELEC 300301	2.3	2,000	1,686	262,514	2030/3/1
	2.3 AMERICAN TOWE 310915	2.3	1,000	810	126,148	2031/9/15
	2.3 CHARTER COMM 320201	2.3	2,000	1,523	237,247	2032/2/1
	2.355 VERIZON COM 320315	2.355	4,500	3,650	568,395	2032/3/15
	2.4 VIRGINIA ELEC 320330	2.4	4,000	3,268	508,872	2032/3/30
	2.5 TRANSCANADA P 311012	2.5	7,000	5,776	899,384	2031/10/12
	2.55 AT&T INC 331201	2.55	14,900	11,747	1,829,026	2033/12/1
	2.55 T-MOBILE USA 310215	2.55	4,000	3,368	524,464	2031/2/15
	2.55 VERIZON COMM 310321	2.55	4,500	3,792	590,556	2031/3/21
	2.65 CENTERPOINT 310601	2.65	3,000	2,518	392,138	2031/6/1
	2.65 FIRSTENERGY 300301	2.65	2,000	1,711	266,408	2030/3/1
	2.65 VERIZON COMM 401120	2.65	6,000	4,128	642,814	2040/11/20
	2.75 AMERICAN TOW 270115	2.75	5,500	5,155	802,660	2027/1/15
	2.75 NEXTERA ENER 291101	2.75	5,000	4,425	688,985	2029/11/1
	2.772 BP CAP MARK 501110	2.772	1,000	625	97,403	2050/11/10
	2.8 CHARTER COMM 310401	2.8	5,000	4,055	631,396	2031/4/1
	2.8 ENTERGY CORP 300615	2.8	6,200	5,372	836,451	2030/6/15
	2.8 ENTERPRISE PR 300131	2.8	5,500	4,887	760,950	2030/1/31
	2.8 VALERO ENERGY 311201	2.8	4,000	3,367	524,280	2031/12/1
	2.85 BERKSHIRE HA 510515	2.85	1,000	616	95,951	2051/5/15
	2.85 DOMINION ENE 260815	2.85	500	473	73,780	2026/8/15
	2.85 SOUTHERN CAL 290801	2.85	1,000	893	139,123	2029/8/1
	2.875 T-MOBILE US 310215	2.875	2,500	2,149	334,633	2031/2/15
	2.875 VERIZON COM 501120	2.875	2,000	1,259	196,069	2050/11/20
	2.887 COMCAST COR 511101	2.887	7,656	4,774	743,430	2051/11/1
	2.891 UNION PACIF 360406	2.891	4,000	3,209	499,684	2036/4/6
	2.9 CENTERPOINT E 500701	2.9	2,500	1,607	250,358	2050/7/1
	2.92 HALLIBURTON 300301	2.92	5,000	4,444	692,037	2030/3/1
	2.937 COMCAST COR 561101	2.937	11,612	7,018	1,092,790	2056/11/1
	2.939 BP CAP MARK 510604	2.939	5,500	3,549	552,600	2051/6/4
	2.95 CANADIAN NAT 300715	2.95	5,000	4,366	679,875	2030/7/15
	2.95 CENTERPOINT 300301	2.95	1,000	882	137,379	2030/3/1
	2.95 NISOURCE INC 290901	2.95	4,000	3,580	557,417	2029/9/1
	3 NEXTERA ENERGY 520115	3.0	1,000	631	98,328	2052/1/15
	3 SHELL INTERNATI 511126	3.0	2,000	1,314	204,668	2051/11/26
	3 T-MOBILE USA IN 410215	3.0	3,300	2,369	368,899	2041/2/15
	3.05 NORFOLK SOUT 500515	3.05	1,000	652	101,536	2050/5/15
	3.06 BP CAP MARKE 410617	3.06	7,000	5,133	799,275	2041/6/17
	3.095 EXXON MOBIL 490816	3.095	2,000	1,371	213,537	2049/8/16

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
普通社債券						
3.125 ALABAMA POW 510715	3.125	2,000	1,340	208,638	2051/7/15	
3.125 COMMONWEAL 510315	3.125	1,000	655	102,076	2051/3/15	
3.125 ENBRIDGE IN 291115	3.125	1,000	901	140,288	2029/11/15	
3.15 FLORIDA POWE 491001	3.15	1,000	682	106,292	2049/10/1	
3.15 PACIFIC GAS 260101	3.15	1,500	1,440	224,323	2026/1/1	
3.15 SOUTHWESTERN 500501	3.15	1,000	638	99,482	2050/5/1	
3.15 VERIZON COMM 300322	3.15	2,500	2,241	348,940	2030/3/22	
3.2 CON EDISON CO 511201	3.2	5,000	3,313	515,920	2051/12/1	
3.2 ROGERS COMMUN 270315	3.2	2,000	1,891	294,580	2027/3/15	
3.25 DCP MIDSTREA 320215	3.25	1,500	1,283	199,765	2032/2/15	
3.25 DUKE ENERGY 491001	3.25	2,000	1,352	210,528	2049/10/1	
3.25 FEDEX CORP 410515	3.25	2,000	1,460	227,379	2041/5/15	
3.25 SHELL INTERN 500406	3.25	5,500	3,838	597,731	2050/4/6	
3.3 AT&T INC 520201	3.3	1,500	1,004	156,335	2052/2/1	
3.3 CROWN CASTLE 300701	3.3	3,000	2,650	412,735	2030/7/1	
3.3 DOMINION ENER 410415	3.3	2,000	1,462	227,682	2041/4/15	
3.3 KENTUCKY UTIL 500601	3.3	1,000	681	106,126	2050/6/1	
3.3 PACIFICCORP 510315	3.3	3,000	1,941	302,248	2051/3/15	
3.3 SEMPRA 250401	3.3	2,500	2,447	381,120	2025/4/1	
3.3 VIRGINIA ELEC 491201	3.3	1,000	687	107,041	2049/12/1	
3.32 SAN DIEGO G 500415	3.32	3,000	2,039	317,517	2050/4/15	
3.337 BAKER HUGHE 271215	3.337	1,500	1,412	219,867	2027/12/15	
3.35 CSX CORP 490915	3.35	1,500	1,054	164,208	2049/9/15	
3.35 ENTERGY ARKA 520615	3.35	3,000	2,026	315,586	2052/6/15	
3.375 DOMINION EN 300401	3.375	6,000	5,390	839,238	2030/4/1	
3.375 EVERSOURCE 320301	3.375	1,500	1,284	199,962	2032/3/1	
3.4 DTE ENERGY CO 290615	3.4	8,396	7,648	1,190,865	2029/6/15	
3.4 DUKE ENERGY C 290615	3.4	4,000	3,681	573,236	2029/6/15	
3.4 DUKE ENERGY F 461001	3.4	1,000	710	110,563	2046/10/1	
3.4 NORTHERN STAT 420815	3.4	1,000	759	118,195	2042/8/15	
3.4 VERIZON COMMU 410322	3.4	3,000	2,292	356,908	2041/3/22	
3.4 XCEL ENERGY I 300601	3.4	1,000	892	138,967	2030/6/1	
3.45 ALABAMA POWE 491001	3.45	2,000	1,430	222,697	2049/10/1	
3.5 AT&T INC 410601	3.5	7,000	5,325	829,110	2041/6/1	
3.5 AT&T INC 530915	3.5	15,916	10,745	1,673,128	2053/9/15	
3.5 CANADIAN PACI 500501	3.5	2,000	1,435	223,441	2050/5/1	
3.5 CHARTER COMM 410601	3.5	1,000	661	103,013	2041/6/1	
3.5 DUKE ENERGY C 510615	3.5	2,000	1,360	211,862	2051/6/15	
3.5 FOX CORP 300408	3.5	3,000	2,716	422,958	2030/4/8	
3.5 PACIFIC GAS & 500801	3.5	1,000	660	102,845	2050/8/1	
3.5 PIEDMONT NATU 290601	3.5	1,500	1,385	215,744	2029/6/1	
3.5 SPECTRA ENERG 250315	3.5	350	343	53,537	2025/3/15	
3.5 T-MOBILE USA 310415	3.5	10,500	9,384	1,461,229	2031/4/15	
3.5 WALT DISNEY C 400513	3.5	3,000	2,390	372,185	2040/5/13	
3.55 AT&T INC 550915	3.55	14,500	9,731	1,515,261	2055/9/15	

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日		
		利率	額面金額	評価額				
				外貨建金額	邦貨換算金額			
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ	普通社債券	3.55	ENTERGY TEXA 490930	3.55	1,000	714	111,245	2049/9/30
		3.55	3.55 PLAINS ALL A 291215	3.55	5,000	4,550	708,515	2029/12/15
		3.55	3.55 VERIZON COMM 510322	3.55	3,500	2,509	390,708	2051/3/22
		3.6	3.6 NORTHERN STAT 470915	3.6	2,000	1,479	230,422	2047/9/15
		3.65	3.65 AT&T INC 510601	3.65	3,000	2,118	329,809	2051/6/1
		3.65	3.65 AT&T INC 590915	3.65	1,462	976	152,061	2059/9/15
		3.65	3.65 DTE ELECTRIC 520301	3.65	1,500	1,102	171,638	2052/3/1
		3.65	3.65 MIDAMERICAN 480801	3.65	2,000	1,497	233,130	2048/8/1
		3.65	3.65 SOUTHERN CAL 280301	3.65	3,000	2,837	441,811	2028/3/1
		3.65	3.65 WOODSIDE FI 250305	3.65	4,800	4,718	734,637	2025/3/5
		3.7	3.7 ALABAMA POWER 471201	3.7	1,000	757	117,893	2047/12/1
		3.7	3.7 AMERICAN TOWE 491015	3.7	4,800	3,439	535,528	2049/10/15
		3.7	3.7 CENTERPOINT E 490901	3.7	4,000	2,870	446,887	2049/9/1
		3.7	3.7 DTE ELECTRIC 450315	3.7	5,000	3,874	603,198	2045/3/15
		3.7	3.7 FLORIDA POWER 471201	3.7	1,000	765	119,260	2047/12/1
		3.7	3.7 GEORGIA POWER 500130	3.7	3,000	2,230	347,273	2050/1/30
		3.7	3.7 ONCOR ELECTRI 500515	3.7	1,000	745	116,105	2050/5/15
		3.75	3.75 AEP TRANSMIS 471201	3.75	1,000	749	116,762	2047/12/1
		3.75	3.75 CHARTER COMM 280215	3.75	5,000	4,631	721,066	2028/2/15
		3.75	3.75 COMCAST CORP 400401	3.75	6,800	5,517	859,124	2040/4/1
		3.75	3.75 DTE ELECTRIC 470815	3.75	1,000	763	118,870	2047/8/15
		3.75	3.75 DUKE ENERGY 460515	3.75	3,000	2,277	354,577	2046/5/15
		3.75	3.75 DUKE ENERGY 460901	3.75	5,500	4,050	630,683	2046/9/1
		3.75	3.75 ENERGY TRANS 300515	3.75	11,000	10,066	1,567,298	2030/5/15
		3.75	3.75 PACIFIC GAS 280701	3.75	1,500	1,398	217,677	2028/7/1
		3.75	3.75 T-MOBILE USA 270415	3.75	4,500	4,318	672,422	2027/4/15
		3.755	3.755 WARNERMEDIA 270315	3.755	2,500	2,376	369,963	2027/3/15
		3.758	3.758 CONOCOPHILL 420315	3.758	2,300	1,843	286,971	2042/3/15
		3.8	3.8 AEP TRANSMISS 490615	3.8	1,500	1,126	175,400	2049/6/15
		3.8	3.8 AMERICAN TOWE 290815	3.8	2,000	1,849	287,931	2029/8/15
		3.8	3.8 BERKSHIRE HAT 480715	3.8	1,000	737	114,810	2048/7/15
		3.8	3.8 CONOCOPHILLIP 520315	3.8	2,000	1,508	234,927	2052/3/15
		3.8	3.8 CROWN CASTLE 280215	3.8	1,000	943	146,935	2028/2/15
		3.8	3.8 ONCOR ELECTRI 470930	3.8	1,000	765	119,132	2047/9/30
		3.8	3.8 PLAINS ALL AM 300915	3.8	1,500	1,363	212,257	2030/9/15
		3.8	3.8 ROGERS COMMUN 320315	3.8	4,500	3,988	621,049	2032/3/15
		3.8	3.8 SEMPRA ENERGY 380201	3.8	1,000	812	126,520	2038/2/1
		3.8	3.8 VIRGINIA ELEC 470915	3.8	2,500	1,873	291,708	2047/9/15
		3.839	3.839 UNION PACIF 600320	3.839	4,050	2,999	467,010	2060/3/20
		3.85	3.85 CANADIAN NAT 270601	3.85	8,000	7,673	1,194,817	2027/6/1
		3.85	3.85 SOUTHWESTERN 480201	3.85	1,000	719	112,084	2048/2/1
		3.875	3.875 T-MOBILE US 300415	3.875	12,500	11,605	1,806,961	2030/4/15
		3.9	3.9 BURLINGTN NOR 460801	3.9	4,000	3,172	493,896	2046/8/1
		3.9	3.9 CANADIAN NATL 250201	3.9	2,000	1,974	307,447	2025/2/1
		3.9	3.9 FEDEX CORP 350201	3.9	500	439	68,491	2035/2/1

銘柄	銘柄	当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		千円	
				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			
	普通社債券						
	3.9 WILLIAMS PART 250115	3.9	6,500	6,421	999,886	2025/1/15	
	3.95 AMERICAN TOW 290315	3.95	1,000	939	146,276	2029/3/15	
	3.95 CSX CORP 500501	3.95	2,500	1,956	304,627	2050/5/1	
	3.95 DISCOVERY CO 280320	3.95	11,400	10,716	1,668,594	2028/3/20	
	3.95 DUKE ENERGY 480315	3.95	2,000	1,546	240,725	2048/3/15	
	3.95 FLORIDA POWE 480301	3.95	3,000	2,380	370,716	2048/3/1	
	3.95 MISSISSIPPI 280330	3.95	2,000	1,913	297,855	2028/3/30	
	3.95 NISOURCE INC 480330	3.95	3,000	2,258	351,640	2048/3/30	
	3.95 ONEOK INC 500301	3.95	1,000	731	113,955	2050/3/1	
	3.969 COMCAST COR 471101	3.969	6,602	5,155	802,768	2047/11/1	
	3.999 COMCAST COR 491101	3.999	725	565	88,076	2049/11/1	
	4 DISCOVERY COMMU 550915	4.0	6,000	3,955	615,798	2055/9/15	
	4 ENBRIDGE INC 491115	4.0	1,000	757	118,009	2049/11/15	
	4 SEMPRA ENERGY 480201	4.0	5,500	4,174	649,951	2048/2/1	
	4 SOUTHERN CAL ED 470401	4.0	4,000	3,081	479,734	2047/4/1	
	4.025 CONOCOPHILL 620315	4.025	3,650	2,761	429,988	2062/3/15	
	4.05 AMERICAN TOW 320315	4.05	2,500	2,275	354,317	2032/3/15	
	4.05 UNION PACIFI 460301	4.05	2,000	1,616	251,693	2046/3/1	
	4.08 BAKER HUGHES 471215	4.08	2,500	2,006	312,384	2047/12/15	
	4.1 AT&T INC 280215	4.1	4,000	3,856	600,388	2028/2/15	
	4.1 CENTERPOINT E 470901	4.1	1,000	789	122,891	2047/9/1	
	4.1 CSX CORP 440315	4.1	150	124	19,409	2044/3/15	
	4.1 DUKE ENERGY P 420515	4.1	2,500	2,061	320,930	2042/5/15	
	4.1 NORFOLK SOUTH 490515	4.1	1,800	1,423	221,570	2049/5/15	
	4.1 PUBLIC SERVIC 320601	4.1	2,000	1,838	286,328	2032/6/1	
	4.1 TRANSCANADA P 300415	4.1	4,000	3,741	582,487	2030/4/15	
	4.114 EXXON MOBIL 460301	4.114	3,000	2,511	390,964	2046/3/1	
	4.125 CON EDISON 490515	4.125	2,000	1,582	246,329	2049/5/15	
	4.125 DISCOVERY C 290515	4.125	3,500	3,238	504,268	2029/5/15	
	4.125 PPL CAPITAL 300415	4.125	1,500	1,425	221,967	2030/4/15	
	4.125 SOUTHERN CA 480301	4.125	5,500	4,303	670,114	2048/3/1	
	4.125 VERIZON COM 270316	4.125	1,000	975	151,860	2027/3/16	
	4.15 BURLINGTN NO 450401	4.15	8,000	6,671	1,038,757	2045/4/1	
	4.15 BURLINGTN NO 481215	4.15	3,500	2,874	447,599	2048/12/15	
	4.15 ENABLE MIDST 290915	4.15	4,000	3,773	587,459	2029/9/15	
	4.15 NORFOLK SOUT 480228	4.15	2,500	2,012	313,282	2048/2/28	
	4.15 PPL ELECTRIC 480615	4.15	5,500	4,499	700,588	2048/6/15	
	4.2 CANADIAN PACI 691115	4.2	1,000	763	118,832	2069/11/15	
	4.2 DUKE ENERGY C 490615	4.2	3,000	2,338	364,143	2049/6/15	
	4.2 DUKE ENERGY F 480715	4.2	3,500	2,825	440,003	2048/7/15	
	4.2 PACIFIC GAS & 410601	4.2	3,000	2,382	370,892	2041/6/1	
	4.2 SABINE PASS L 280315	4.2	1,000	965	150,263	2028/3/15	
	4.2 SOUTHERN CAL 290301	4.2	2,000	1,914	298,032	2029/3/1	
	4.227 EXXON MOBIL 400319	4.227	3,000	2,662	414,622	2040/3/19	
	4.25 APACHE CORP 300115	4.25	3,000	2,769	431,274	2030/1/15	

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日		
		利 率	額面金額	評 価 額				
				外貨建金額	邦貨換算金額			
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ	普通社債券	4.25	CENOVUS ENER 270415	4.25	1,000	972	151,429	2027/4/15
		4.25	CENTERPOINT 281101	4.25	592	563	87,787	2028/11/1
		4.25	CENTERPOINT 490201	4.25	1,300	1,072	166,965	2049/2/1
		4.25	COMCAST CORP 301015	4.25	4,000	3,815	594,106	2030/10/15
		4.25	COMCAST CORP 330115	4.25	3,000	2,797	435,552	2033/1/15
		4.25	DUKE ENERGY 411215	4.25	3,000	2,521	392,648	2041/12/15
		4.25	ENTERPRISE P 480215	4.25	2,000	1,650	257,039	2048/2/15
		4.25	INDIANA MICH 480815	4.25	2,500	1,991	310,101	2048/8/15
		4.25	LOUISVILLE G 490401	4.25	2,500	2,001	311,710	2049/4/1
		4.25	MIDAMERICAN 460501	4.25	2,000	1,648	256,731	2046/5/1
		4.25	MIDAMERICAN 490715	4.25	2,000	1,650	256,934	2049/7/15
		4.25	MISSISSIPPI 420315	4.25	2,000	1,647	256,469	2042/3/15
		4.25	SOUTHERN CO 360701	4.25	3,450	3,052	475,236	2036/7/1
		4.25	TRANSCANADA 280515	4.25	1,500	1,442	224,559	2028/5/15
		4.279	WARNERMEDIA 320315	4.279	5,000	4,371	680,706	2032/3/15
		4.3	AMERICAN ELEC 281201	4.3	8,000	7,683	1,196,274	2028/12/1
		4.3	AT&T INC 300215	4.3	2,000	1,908	297,150	2030/2/15
		4.3	CON EDISON CO 561201	4.3	2,000	1,587	247,098	2056/12/1
		4.3	CONOCOPHILLIP 441115	4.3	4,200	3,574	556,603	2044/11/15
		4.3	CSX CORP 480301	4.3	7,500	6,287	978,974	2048/3/1
		4.3	HESS CORP 270401	4.3	5,500	5,363	835,076	2027/4/1
		4.3	PACIFIC GAS & 450315	4.3	1,000	772	120,216	2045/3/15
		4.327	EXXON MOBIL 500319	4.327	2,400	2,038	317,416	2050/3/19
		4.329	VERIZON COM 280921	4.329	1,000	970	151,069	2028/9/21
		4.35	AT&T INC 290301	4.35	13,000	12,570	1,957,238	2029/3/1
		4.375	KENTUCKY UT 451001	4.375	1,000	837	130,391	2045/10/1
		4.375	NISOURCE IN 470515	4.375	1,000	812	126,486	2047/5/15
		4.375	SHELL INTER 450511	4.375	2,950	2,545	396,262	2045/5/11
		4.375	T-MOBILE US 400415	4.375	2,000	1,737	270,581	2040/4/15
		4.4	ENERGY TRANSF 270315	4.4	6,000	5,853	911,457	2027/3/15
		4.4	MARATHON OIL 270715	4.4	2,250	2,183	339,981	2027/7/15
		4.4	SOUTHERN CO 460701	4.4	1,750	1,468	228,569	2046/7/1
		4.45	BERKSHIRE HA 490115	4.45	1,000	824	128,353	2049/1/15
		4.45	BURLINGTN NO 530115	4.45	3,500	2,996	466,604	2053/1/15
		4.45	ENTERPRISE P 430215	4.45	1,000	865	134,736	2043/2/15
		4.45	EXELON CORP 460415	4.45	3,100	2,581	401,962	2046/4/15
		4.45	META PLATFOR 520815	4.45	500	427	66,484	2052/8/15
		4.5	APPALACHIAN P 320801	4.5	4,000	3,688	574,266	2032/8/1
		4.5	APPALACHIAN P 490301	4.5	1,000	800	124,603	2049/3/1
		4.5	AT&T INC 350515	4.5	7,050	6,456	1,005,240	2035/5/15
		4.5	AT&T INC 480309	4.5	5,886	4,852	755,502	2048/3/9
		4.5	CON EDISON CO 580515	4.5	4,000	3,303	514,329	2058/5/15
		4.5	CSX CORP 521115	4.5	1,000	859	133,901	2052/11/15
		4.5	ENTERGY TEXAS 390330	4.5	1,000	883	137,580	2039/3/30
		4.5	PACIFIC GAS & 400701	4.5	6,500	5,386	838,661	2040/7/1

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
アメリカ	普通社債券					
	4.5 PLAINS ALL AM 261215	4.5	5,000	4,894	762,032	2026/12/15
	4.5 PUBLIC SERVIC 520601	4.5	2,000	1,635	254,663	2052/6/1
	4.5 SABINE PASS L 300515	4.5	9,000	8,588	1,337,217	2030/5/15
	4.5 TRANSURBAN QL 280419	4.5	3,300	3,168	493,307	2028/4/19
	4.5 UNION PACIFIC 480910	4.5	3,000	2,584	402,433	2048/9/10
	4.5 VERIZON COMMU 330810	4.5	8,000	7,508	1,169,032	2033/8/10
	4.522 VERIZON COM 480915	4.522	3,424	2,933	456,706	2048/9/15
	4.55 FEDEX CORP 460401	4.55	11,300	9,448	1,471,208	2046/4/1
	4.55 NORFOLK SOUT 530601	4.55	2,000	1,695	263,939	2053/6/1
	4.55 NSTAR ELECTR 520601	4.55	2,500	2,127	331,261	2052/6/1
	4.55 ONCOR ELECTR 320915	4.55	4,500	4,286	667,356	2032/9/15
	4.55 ONEOK INC 280715	4.55	6,000	5,834	908,379	2028/7/15
	4.55 PACIFIC GAS 300701	4.55	2,000	1,886	293,674	2030/7/1
	4.55 ROGERS COMMU 520315	4.55	5,500	4,478	697,307	2052/3/15
	4.6 BERKSHIRE HAT 530501	4.6	2,000	1,663	259,061	2053/5/1
	4.6 PECO ENERGY C 520515	4.6	2,500	2,176	338,956	2052/5/15
	4.6 XCEL ENERGY I 320601	4.6	4,500	4,199	653,938	2032/6/1
	4.65 META PLATFOR 620815	4.65	4,700	4,034	628,165	2062/8/15
	4.65 PHILLIPS 66 341115	4.65	1,500	1,396	217,470	2034/11/15
	4.65 PIEDMONT NAT 430801	4.65	1,500	1,292	201,270	2043/8/1
	4.7 DOMINION EMER 441201	4.7	1,000	852	132,748	2044/12/1
	4.7 EXELON CORP 500415	4.7	2,000	1,705	265,510	2050/4/15
	4.7 GEORGIA POWER 320515	4.7	2,000	1,928	300,279	2032/5/15
	4.7 MPLX LP 480415	4.7	1,000	834	129,862	2048/4/15
	4.75 ENERGY TRANS 260115	4.75	4,500	4,447	692,495	2026/1/15
	4.75 GEORGIA POWE 400901	4.75	3,700	3,333	519,033	2040/9/1
	4.75 T-MOBILE USA 280201	4.75	1,000	984	153,247	2028/2/1
	4.8 CANADIAN PACI 450801	4.8	2,000	1,801	280,485	2045/8/1
	4.8 CHARTER COMM 500301	4.8	4,700	3,426	533,464	2050/3/1
	4.8 COMCAST CORP 330515	4.8	5,000	4,847	754,684	2033/5/15
	4.8 CROWN CASTLE 280901	4.8	3,000	2,925	455,455	2028/9/1
	4.8 ENTERPRISE PR 490201	4.8	1,000	890	138,654	2049/2/1
	4.8 MPLX LP 290215	4.8	2,000	1,958	305,004	2029/2/15
	4.8 NISOURCE INC 440215	4.8	1,000	874	136,118	2044/2/15
	4.8 T-MOBILE USA 280715	4.8	4,500	4,429	689,682	2028/7/15
	4.812 BP CAP MARK 330213	4.812	11,500	11,177	1,740,288	2033/2/13
	4.85 ENTERPRISE P 340131	4.85	2,000	1,940	302,165	2034/1/31
	4.85 ENTERPRISE P 420815	4.85	1,750	1,597	248,781	2042/8/15
	4.85 ENTERPRISE P 440315	4.85	1,250	1,136	176,886	2044/3/15
	4.85 HALLIBURTON 351115	4.85	4,800	4,601	716,429	2035/11/15
	4.85 PPL ELECTRIC 340215	4.85	3,000	2,915	453,869	2034/2/15
	4.862 VERIZON COM 460821	4.862	7,110	6,471	1,007,610	2046/8/21
	4.875 MPLX LP 250601	4.875	5,000	4,963	772,883	2025/6/1
	4.875 TRANSCANADA 260115	4.875	4,000	3,965	617,459	2026/1/15
	4.875 VODAFONE GR 490619	4.875	1,000	870	135,469	2049/6/19

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	普通社債券	4.893 BP CAP MARK 330911	4.893	3,000	2,931	456,427	2033/9/11
		4.9 DOMINION RESO 410801	4.9	200	176	27,553	2041/8/1
		4.9 FEDEX CORP 340115	4.9	1,500	1,450	225,888	2034/1/15
		4.9 VALERO ENERGY 450315	4.9	1,000	900	140,250	2045/3/15
		4.9 WILLIAMS COMP 290315	4.9	3,000	2,955	460,169	2029/3/15
		4.908 CCO SAFARI 250723	4.908	3,380	3,352	521,977	2025/7/23
		4.95 BOARDWALK PI 241215	4.95	1,500	1,491	232,286	2024/12/15
		4.95 ENERGY TRANS 280615	4.95	4,000	3,943	614,021	2028/6/15
		4.95 FEDEX CORP 481017	4.95	1,000	882	137,471	2048/10/17
		4.95 MPLX LP 320901	4.95	3,500	3,352	521,944	2032/9/1
		4.95 NEXTERA ENER 260129	4.95	2,000	1,989	309,802	2026/1/29
		4.95 ONCOR ELECTR 520915	4.95	5,000	4,540	706,881	2052/9/15
		4.95 PACIFIC GAS 500701	4.95	10,500	8,764	1,364,610	2050/7/1
		4.95 PHILLIPS 66 271201	4.95	1,000	995	154,933	2027/12/1
		4.989 BP CAP MARK 340410	4.989	3,000	2,945	458,592	2034/4/10
		5 CROWN CASTLE IN 280111	5.0	2,500	2,462	383,468	2028/1/11
		5 DEVON ENERGY CO 450615	5.0	1,000	870	135,509	2045/6/15
		5 DUKE ENERGY COR 251208	5.0	7,000	6,970	1,085,237	2025/12/8
		5 NEXTERA ENERGY 320715	5.0	1,000	975	151,945	2032/7/15
		5 NISOURCE INC 520615	5.0	1,000	894	139,324	2052/6/15
		5 PPL ELECTRIC UT 330515	5.0	2,000	1,967	306,337	2033/5/15
		5 ROGERS COMMUNIC 290215	5.0	5,000	4,922	766,382	2029/2/15
		5 SABINE PASS LIQ 270315	5.0	4,000	3,971	618,316	2027/3/15
		5.012 VERIZON COM 490415	5.012	4,000	3,827	595,865	2049/4/15
		5.012 VERIZON COM 540821	5.012	2,250	2,060	320,836	2054/8/21
		5.05 CHARTER COMM 290330	5.05	6,250	5,975	930,350	2029/3/30
		5.05 T-MOBILE USA 330715	5.05	1,500	1,462	227,665	2033/7/15
		5.05 UNITED PARCE 530303	5.05	2,000	1,891	294,446	2053/3/3
		5.05 WARNERMEDIA 420315	5.05	1,000	820	127,758	2042/3/15
		5.1 APACHE CORP 400901	5.1	2,000	1,701	264,921	2040/9/1
		5.1 DTE ENERGY CO 290301	5.1	3,500	3,454	537,941	2029/3/1
		5.1 ENTERPRISE PR 450215	5.1	2,500	2,330	362,875	2045/2/15
		5.1 EXELON CORP 450615	5.1	150	136	21,285	2045/6/15
		5.1 NORTHERN STAT 530515	5.1	1,500	1,401	218,233	2053/5/15
		5.1 TRANSCANADA P 490315	5.1	5,000	4,505	701,520	2049/3/15
		5.1 WILLIAMS COMP 450915	5.1	3,500	3,172	493,928	2045/9/15
		5.125 GEORGIA POW 520515	5.125	5,000	4,661	725,800	2052/5/15
		5.141 WARNERMEDIA 520315	5.141	2,000	1,572	244,834	2052/3/15
		5.15 CENTERPOINT 340301	5.15	3,000	2,969	462,283	2034/3/1
		5.15 ENTERGY ARKA 330115	5.15	1,000	985	153,486	2033/1/15
		5.15 T-MOBILE USA 340415	5.15	4,000	3,918	610,122	2034/4/15
		5.2 AMERICAN ELEC 290115	5.2	3,000	2,987	465,083	2029/1/15
		5.2 BURLINGTN NOR 540415	5.2	2,800	2,686	418,336	2054/4/15
		5.2 CROWN CASTLE 490215	5.2	1,000	907	141,240	2049/2/15
		5.2 CSX CORP 331115	5.2	1,500	1,502	233,872	2033/11/15

銘柄	銘柄	当 期 末						
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日		
				外貨建金額	邦貨換算金額			
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ	普通社債券	5.2	DISCOVERY COM 470920	5.2	1,500	1,212	188,822	2047/9/20
		5.2	DTE ELECTRIC 340301	5.2	3,000	2,969	462,329	2034/3/1
		5.2	MARATHON OIL 450601	5.2	4,000	3,487	542,950	2045/6/1
		5.2	MPLX LP 470301	5.2	2,200	1,982	308,621	2047/3/1
		5.2	ONEOK INC 480715	5.2	1,000	887	138,247	2048/7/15
		5.2	SOUTHERN CAL 340601	5.2	3,000	2,918	454,364	2034/6/1
		5.2	SOUTHERN CO 330615	5.2	2,500	2,451	381,694	2033/6/15
		5.213	TELEFONICA 470308	5.213	1,300	1,160	180,751	2047/3/8
		5.25	DOMINION RES 330801	5.25	346	336	52,434	2033/8/1
		5.25	DUKE ENERGY 330401	5.25	1,000	990	154,174	2033/4/1
		5.25	ENERGY TRANS 290415	5.25	8,000	7,970	1,241,082	2029/4/15
		5.25	FEDEX CORP 500515	5.25	1,000	928	144,606	2050/5/15
		5.25	GEORGIA POWE 340315	5.25	3,000	2,978	463,716	2034/3/15
		5.25	NEXTERA ENER 340315	5.25	4,000	3,914	609,491	2034/3/15
		5.25	NEXTERA ENER 530228	5.25	1,500	1,395	217,356	2053/2/28
		5.25	NISOURCE INC 280330	5.25	2,500	2,497	388,808	2028/3/30
		5.25	PACIFIC GAS 520301	5.25	1,000	865	134,680	2052/3/1
		5.25	PPL ELECTRIC 530515	5.25	2,500	2,399	373,575	2053/5/15
		5.3	COMMONWEALTH 530201	5.3	3,000	2,844	442,811	2053/2/1
		5.3	CONOCOPHILLIP 530515	5.3	5,300	5,084	791,669	2053/5/15
		5.3	ENERGY TRANSF 470415	5.3	3,500	3,094	481,817	2047/4/15
		5.3	ENERGY ARKAN 330915	5.3	2,000	1,992	310,223	2033/9/15
		5.3	EXELON CORP 330315	5.3	3,000	2,968	462,163	2033/3/15
		5.3	MARATHON OIL 290401	5.3	3,000	2,972	462,867	2029/4/1
		5.3	PHILLIPS 66 330630	5.3	6,500	6,414	998,694	2033/6/30
		5.3	ROGERS COMMUN 340215	5.3	7,000	6,832	1,063,868	2034/2/15
		5.3	SOUTHERN CAL 280301	5.3	2,500	2,511	391,075	2028/3/1
		5.3	WILLIAMS COMP 520815	5.3	3,900	3,610	562,112	2052/8/15
		5.35	DUKE ENERGY 530315	5.35	2,000	1,901	296,037	2053/3/15
		5.35	ENERGY LOUI 340315	5.35	5,000	4,953	771,273	2034/3/15
		5.35	ENTERPRISE P 330131	5.35	1,000	1,006	156,724	2033/1/31
		5.35	NISOURCE INC 340401	5.35	3,000	2,925	455,517	2034/4/1
		5.35	SUNOCO LOGIS 450515	5.35	500	449	69,930	2045/5/15
		5.375	CHARTER COM 470501	5.375	2,600	2,061	321,051	2047/5/1
		5.375	CON EDISON 340515	5.375	2,000	1,999	311,315	2034/5/15
		5.375	DCP MIDSTRE 250715	5.375	1,590	1,586	247,026	2025/7/15
		5.391	WARNERMEDIA 620315	5.391	3,000	2,362	367,881	2062/3/15
		5.4	AEP TEXAS INC 330601	5.4	1,500	1,469	228,762	2033/6/1
		5.4	AEP TRANSMISS 530315	5.4	1,000	961	149,700	2053/3/15
		5.4	AT&T INC 340215	5.4	2,000	1,987	309,467	2034/2/15
		5.4	CENTERPOINT E 290601	5.4	2,000	2,000	311,439	2029/6/1
		5.4	DTE ELECTRIC 530401	5.4	3,000	2,941	457,939	2053/4/1
		5.4	DUKE ENERGY C 540115	5.4	2,500	2,415	376,139	2054/1/15
		5.4	DUKE ENERGY I 530401	5.4	1,500	1,429	222,503	2053/4/1
		5.4	ENERGY TRANSF 471001	5.4	4,000	3,596	559,970	2047/10/1

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	普通社債券						
	5.4 NISOURCE INC 330630	5.4	2,000	1,974	307,425	2033/6/30	
	5.4 SEMPRA ENERGY 260801	5.4	3,000	2,995	466,336	2026/8/1	
	5.4 WILLIAMS COMP 260302	5.4	5,500	5,502	856,746	2026/3/2	
	5.45 AMERICAN TOW 340215	5.45	5,500	5,438	846,819	2034/2/15	
	5.45 ENTERGY ARKA 340601	5.45	2,000	1,996	310,894	2034/6/1	
	5.45 KINDER MORG 520801	5.45	4,300	3,960	616,590	2052/8/1	
	5.45 PACIFICORP 340215	5.45	3,000	2,930	456,320	2034/2/15	
	5.45 UNION ELECTR 530315	5.45	3,500	3,383	526,833	2053/3/15	
	5.5 COMCAST CORP 640515	5.5	3,500	3,373	525,193	2064/5/15	
	5.5 ENBRIDGE ENER 400915	5.5	200	190	29,612	2040/9/15	
	5.5 MPLX LP 490215	5.5	2,000	1,869	291,042	2049/2/15	
	5.5 SEMPRA 330801	5.5	2,000	1,979	308,131	2033/8/1	
	5.5 SHELL INTERNA 400325	5.5	1,000	1,014	157,926	2040/3/25	
	5.539 AT&T INC 260220	5.539	3,500	3,497	544,609	2026/2/20	
	5.55 AMERICAN TOW 330715	5.55	2,000	1,990	309,968	2033/7/15	
	5.55 DUKE ENERGY 540315	5.55	2,000	1,934	301,152	2054/3/15	
	5.55 KINDER MORG 450601	5.55	5,550	5,197	809,231	2045/6/1	
	5.55 SAN DIEGO G 540415	5.55	3,000	2,931	456,507	2054/4/15	
	5.576 FOX CORP 490125	5.576	3,500	3,197	497,824	2049/1/25	
	5.6 DCP MIDSTREAM 440401	5.6	3,000	2,886	449,493	2044/4/1	
	5.6 DEVON ENERGY 410715	5.6	5,000	4,724	735,601	2041/7/15	
	5.6 EXELON GENERA 420615	5.6	3,000	2,897	451,130	2042/6/15	
	5.6 HESS CORP 410215	5.6	4,000	3,964	617,298	2041/2/15	
	5.6 META PLATFORM 530515	5.6	5,000	5,066	788,906	2053/5/15	
	5.625 DCP MIDSTRE 270715	5.625	5,500	5,551	864,402	2027/7/15	
	5.625 ENBRIDGE IN 340405	5.625	4,000	3,983	620,236	2034/4/5	
	5.625 EXELON CORP 350615	5.625	1,200	1,196	186,300	2035/6/15	
	5.625 SABINE PASS 250301	5.625	8,800	8,787	1,368,185	2025/3/1	
	5.625 VODAFONE GR 530210	5.625	6,000	5,787	901,037	2053/2/10	
	5.65 DUKE ENERGY 530401	5.65	1,000	987	153,691	2053/4/1	
	5.65 MPLX LP 530301	5.65	1,000	949	147,851	2053/3/1	
	5.65 NISOURCE INC 450201	5.65	1,000	962	149,934	2045/2/1	
	5.65 PHILLIPS 66 540615	5.65	2,500	2,437	379,462	2054/6/15	
	5.65 T-MOBILE USA 530115	5.65	6,800	6,701	1,043,397	2053/1/15	
	5.65 WILLIAMS COM 330315	5.65	1,000	1,007	156,940	2033/3/15	
	5.7 AMEREN CORP 261201	5.7	5,000	5,038	784,434	2026/12/1	
	5.7 CONOCOPHILLIP 630915	5.7	2,500	2,527	393,576	2063/9/15	
	5.7 ENBRIDGE INC 330308	5.7	1,000	1,004	156,350	2033/3/8	
	5.7 SOUTHERN CO 340315	5.7	4,000	4,065	633,015	2034/3/15	
	5.749 NEXTERA ENE 250901	5.749	1,000	1,003	156,262	2025/9/1	
	5.75 BURLINGTN NO 400501	5.75	650	669	104,311	2040/5/1	
	5.75 CANADIAN PAC 420115	5.75	1,100	1,080	168,260	2042/1/15	
	5.75 CONSTELLATIO 540315	5.75	2,000	1,935	301,291	2054/3/15	
	5.75 ENERGY TRANS 250401	5.75	1,000	1,002	156,012	2025/4/1	
	5.75 ENERGY TRANS 330215	5.75	2,500	2,513	391,330	2033/2/15	

銘柄	銘柄	当期末					償還年月日
		利率	額面金額	評価額		千円	
				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			
	普通社債券						
	5.75 ENTERGY ARKA 540601	5.75	2,000	1,991	310,126	2054/6/1	
	5.75 META PLATFOR 630515	5.75	1,500	1,537	239,346	2063/5/15	
	5.75 MIDAMERIC 351101	5.75	100	103	16,065	2035/11/1	
	5.75 SOUTHERN CAL 540415	5.75	2,000	1,973	307,276	2054/4/15	
	5.75 SOUTHERN CO 330915	5.75	3,000	3,064	477,141	2033/9/15	
	5.75 T-MOBILE US 340115	5.75	5,000	5,126	798,198	2034/1/15	
	5.8 CONSTELLATION 330301	5.8	7,000	7,108	1,106,801	2033/3/1	
	5.8 CROWN CASTLE 340301	5.8	5,000	5,043	785,310	2034/3/1	
	5.8 ENERGY TRANSF 380615	5.8	1,000	980	152,683	2038/6/15	
	5.8 ENERGY TEXAS 530901	5.8	2,500	2,506	390,218	2053/9/1	
	5.8 HESS CORP 470401	5.8	3,000	3,012	469,051	2047/4/1	
	5.8 MIDAMERICAN 361015	5.8	1,400	1,439	224,059	2036/10/15	
	5.8 PACIFIC GAS & 340515	5.8	2,500	2,487	387,299	2034/5/15	
	5.8 T-MOBILE USA 620915	5.8	1,000	999	155,637	2062/9/15	
	5.85 DTE ENERGY C 340601	5.85	3,000	3,033	472,346	2034/6/1	
	5.875 DUKE ENERGY 331115	5.875	2,000	2,079	323,801	2033/11/15	
	5.875 ENBRIDGE EN 251015	5.875	1,580	1,585	246,853	2025/10/15	
	5.875 NETFLIX INC 281115	5.875	15,500	15,980	2,488,177	2028/11/15	
	5.875 SABINE PASS 260630	5.875	2,500	2,513	391,424	2026/6/30	
	5.875 TIME WARNER 401115	5.875	600	512	79,831	2040/11/15	
	5.9 AMEREN ILLINO 521201	5.9	1,000	1,039	161,811	2052/12/1	
	5.9 CON EDISON CO 531115	5.9	2,000	2,061	320,978	2053/11/15	
	5.9 SABINE PASS L 370915	5.9	2,000	2,032	316,522	2037/9/15	
	5.95 BOARDWALK PI 260601	5.95	1,000	1,006	156,779	2026/6/1	
	5.95 CANADIAN PAC 370515	5.95	700	722	112,528	2037/5/15	
	5.95 DOMINION R 350615	5.95	2,150	2,178	339,254	2035/6/15	
	5.95 ENERGY TRANS 540515	5.95	1,000	967	150,618	2054/5/15	
	5.95 EVERSOURCE E 290201	5.95	2,000	2,045	318,434	2029/2/1	
	5.95 EVERSOURCE E 340715	5.95	2,000	2,019	314,454	2034/7/15	
	5.95 NORFOLK SOUT 640315	5.95	1,500	1,542	240,141	2064/3/15	
	5.95 SOUTHERN CAL 321101	5.95	2,500	2,582	402,098	2032/11/1	
	6 SEMPRA ENERGY 391015	6.0	1,450	1,456	226,719	2039/10/15	
	6 T-MOBILE US INC 540615	6.0	2,000	2,069	322,219	2054/6/15	
	6.05 DUKE ENERGY 380415	6.05	1,125	1,178	183,462	2038/4/15	
	6.05 ENERGY TRANS 261201	6.05	4,000	4,070	633,727	2026/12/1	
	6.051 NEXTERA ENE 250301	6.051	3,000	3,007	468,248	2025/3/1	
	6.1 DUKE ENERGY C 530915	6.1	3,000	3,083	480,028	2053/9/15	
	6.125 ENERGY TRAN 451215	6.125	1,800	1,774	276,305	2045/12/15	
	6.125 MIDAMERICAN 360401	6.125	4,194	4,366	679,910	2036/4/1	
	6.15 BURLINGTN NO 370501	6.15	2,000	2,157	335,946	2037/5/1	
	6.15 CHARTER COMM 261110	6.15	6,000	6,051	942,251	2026/11/10	
	6.15 CON EDISON C 521115	6.15	1,500	1,595	248,378	2052/11/15	
	6.15 CSX CORP 370501	6.15	1,700	1,826	284,375	2037/5/1	
	6.15 VODAFONE GRO 370227	6.15	3,500	3,649	568,188	2037/2/27	
	6.2 ENBRIDGE INC 301115	6.2	3,000	3,136	488,340	2030/11/15	

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
アメリカ	普通社債券	6.25	1,000	1,087	169,359	2053/10/15
	6.25 ENERGY TRANS 490415	6.25	1,000	1,000	155,841	2049/4/15
	6.25 EXELON GENER 391001	6.25	2,000	2,064	321,445	2039/10/1
	6.3 DOMINION RESO 330315	6.3	250	259	40,421	2033/3/15
	6.3 WILLIAMS PART 400415	6.3	1,200	1,241	193,365	2040/4/15
	6.35 DISCOVERY CO 400601	6.35	2,500	2,410	375,320	2040/6/1
	6.375 NETFLIX INC 290515	6.375	9,000	9,473	1,474,959	2029/5/15
	6.375 OCCIDENTAL 280901	6.375	3,000	3,093	481,616	2028/9/1
	6.384 CHARTER COM 351023	6.384	4,000	3,890	605,802	2035/10/23
	6.4 ENERGY TRANSF 301201	6.4	1,500	1,568	244,185	2030/12/1
	6.4 WALT DISNEY C 351215	6.4	2,500	2,726	424,549	2035/12/15
	6.412 WARNERMEDIA 260315	6.412	3,000	3,000	467,101	2026/3/15
	6.45 ENTERPRISE 400901	6.45	250	271	42,207	2040/9/1
	6.484 CHARTER COM 451023	6.484	7,500	6,886	1,072,166	2045/10/23
	6.497 COLUMBIA PI 430815	6.497	2,000	2,085	324,768	2043/8/15
	6.5 CONSTELLATION 531001	6.5	2,000	2,135	332,450	2053/10/1
	6.5 FOX CORP 331013	6.5	4,500	4,701	732,082	2033/10/13
	6.5 MARATHON PETR 410301	6.5	3,650	3,864	601,773	2041/3/1
	6.5 SUNCOR ENERGY 380615	6.5	5,000	5,254	818,072	2038/6/15
	6.55 CHARTER COMM 340601	6.55	3,000	2,992	465,955	2034/6/1
	6.55 ENERGY TRANS 331201	6.55	2,500	2,645	411,885	2033/12/1
	6.55 TIME WARNER 370501	6.55	500	469	73,154	2037/5/1
	6.6 OCCIDENTAL PE 460315	6.6	4,500	4,696	731,290	2046/3/15
	6.625 OCCIDENTAL 300901	6.625	8,500	8,900	1,385,822	2030/9/1
	6.65 CHARTER COMM 340201	6.65	1,800	1,818	283,074	2034/2/1
	6.65 PLAINS ALL A 370115	6.65	2,500	2,632	409,879	2037/1/15
	6.65 WALT DISNEY 371115	6.65	1,000	1,121	174,656	2037/11/15
	6.75 CONS EDISON 380401	6.75	750	830	129,285	2038/4/1
	6.75 TIME WARNER 390615	6.75	3,000	2,838	441,995	2039/6/15
	6.85 SUNCOR ENERG 390601	6.85	2,000	2,150	334,796	2039/6/1
	6.875 ENTERPRISE 330301	6.875	1,000	1,107	172,504	2033/3/1
	6.875 SPRINT CAPI 281115	6.875	14,500	15,327	2,386,512	2028/11/15
	7 DOMINION RESOUR 380615	7.0	1,300	1,413	220,118	2038/6/15
	7.045 TELEFONICA 360620	7.045	2,000	2,188	340,777	2036/6/20
	7.05 COMCAST CORP 330315	7.05	500	558	86,885	2033/3/15
	7.25 TRANSCANADA 380815	7.25	1,000	1,126	175,346	2038/8/15
	7.3 TIME WARNER 380701	7.3	3,000	2,997	466,696	2038/7/1
	7.4 KINDER MORGAN 310315	7.4	500	549	85,531	2031/3/15
	7.5 ENBRIDGE ENER 380415	7.5	300	343	53,488	2038/4/15
	7.5 ENERGY TRANSF 380701	7.5	500	564	87,865	2038/7/1
	7.5 OCCIDENTAL PE 310501	7.5	4,700	5,179	806,504	2031/5/1
	7.625 SPRINT LLC 260301	7.625	9,500	9,780	1,522,881	2026/3/1
	7.875 DEVON ENERG 310930	7.875	3,000	3,403	529,924	2031/9/30
	8.5 OCCIDENTAL PE 270715	8.5	3,400	3,663	570,438	2027/7/15
	8.75 SPRINT CAPIT 320315	8.75	1,000	1,197	186,503	2032/3/15

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	
	普通社債券					
	FRN FIRSTENERGY 470715	5.1	1,500	1,282	199,657	2047/7/15
	FRN WESTERN MIDS 500201	5.25	1,000	872	135,790	2050/2/1
	FRN WESTERN MIDST 300201	4.05	2,000	1,858	289,433	2030/2/1
	STEP DEUTSCHE TEL 300615	8.75	10,800	12,629	1,966,364	2030/6/15
	STEP ORANGE SA 310301	9.0	4,900	5,864	913,029	2031/3/1
合	計				218,526,998	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

先物取引の銘柄別期末残高

銘	柄	別	当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
			百万円	百万円
外	債券先物取引	NOTE5Y	296	—
		NOTE2Y	728	—
国		T-BOND	—	109
		ULTR10Y 2406	—	524

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

○投資信託財産の構成

(2024年5月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 218,526,998	% 97.1
コール・ローン等、その他	6,492,401	2.9
投資信託財産総額	225,019,399	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（223,013,724千円）の投資信託財産総額（225,019,399千円）に対する比率は99.1%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=155.70円			
------------------	--	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年5月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	225,019,173,690
コール・ローン等	2,584,397,731
公社債(評価額)	218,526,998,828
未収入金	765,958,365
未収利息	2,743,137,011
前払費用	148,142,448
差入委託証拠金	250,539,307
(B) 負債	1,400,369,411
未払金	1,400,369,411
(C) 純資産総額(A-B)	223,618,804,279
元本	85,026,187,493
次期繰越損益金	138,592,616,786
(D) 受益権総口数	85,026,187,493口
1口当たり基準価額(C/D)	26,300円

<注記事項>

- ①期首元本額 56,783,976,023円
期中追加設定元本額 31,801,019,421円
期中一部解約元本額 3,558,807,951円
また、1口当たり純資産額は、期末2.6300円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

三菱UFJ/マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	72,249,869,010円
三菱UFJ/マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>(毎月決算型)	4,990,533,153円
三菱UFJ/マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジなし>(年1回決算型)	4,017,709,057円
マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>(FOFs用)(適格機関投資家限定)	3,023,857,226円
三菱UFJ/マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>(年1回決算型)	636,369,365円
外国債券アクティブファンドセレクション(ラップ専用)	100,205,920円
三菱UFJ/マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジなし>(隔月決算型)	7,643,762円
合計	85,026,187,493円

[お知らせ]

- ①新NISA(成長投資枠)の要件対応のため、デリバティブ取引にかかる投資制限について記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2023年8月1日)
- ②委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。
(2023年10月1日)

○損益の状況 (2023年5月11日~2024年5月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	9,333,106,222
受取利息	9,333,472,879
支払利息	△ 366,657
(B) 有価証券売買損益	22,084,517,127
売買益	25,695,399,568
売買損	△ 3,610,882,441
(C) 先物取引等取引損益	△ 216,751,538
取引益	772,056,102
取引損	△ 988,807,640
(D) 保管費用等	△ 19,789,606
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	31,181,082,205
(F) 前期繰越損益金	68,544,304,051
(G) 追加信託差損益金	43,897,286,579
(H) 解約差損益金	△ 5,030,056,049
(I) 計(E+F+G+H)	138,592,616,786
次期繰越損益金(I)	138,592,616,786

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

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

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