

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／インデックス型	
信託期間	無期限（2010年10月29日設定）	
運用方針	新興国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として新興国の現地通貨建ての公社債に実質的な投資を行い、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債、および新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価額等が連動する債券に投資することがあります。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。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の実質投資比率が100%を超える場合があります。実質的な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ません。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引を行うことがあります。	
主要運用対象	ベビーフンド	新興国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、新興国の現地通貨建ての公社債に直接投資することがあります。
	マザーファンド	新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーフンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	
	分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）	

運用報告書（全体版）

三菱UFJ
DC新興国債券インデックスファンド

第14期（決算日：2024年1月26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 DC新興国債券インデックスファンド」は、去る1月26日に第14期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ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5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			JPモルガンGBI-EM グローバル・ダイバーシファイド (円換算ベース)		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
		税 分	込 配	み 金	期 騰	中 落			
	円		円			円			円
10期(2020年1月27日)	13,371		0			34,193.00	97.4	—	10,457
11期(2021年1月26日)	12,760		0	△	4.6	32,923.96	97.6	—	11,457
12期(2022年1月26日)	12,899		0		1.1	33,419.11	97.5	—	13,227
13期(2023年1月26日)	13,531		0		4.9	35,262.54	97.1	—	15,579
14期(2024年1月26日)	16,172		0		19.5	42,305.98	96.1	—	21,390

(注) JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)とは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表しているJPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(ドルベース)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) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		J P モ ル ガ ン G B I - E M グ ロー バ ル ・ ダ イ バ ー シ フ ァ イ ド (円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2023年 1 月 26 日	円	%		%	%	%
	13,531	—	35,262.54	—	97.1	—
1 月 末	13,553	0.2	35,423.91	0.5	96.7	—
2 月 末	13,723	1.4	35,809.02	1.5	96.7	—
3 月 末	13,929	2.9	36,370.53	3.1	97.1	—
4 月 末	14,110	4.3	36,860.17	4.5	96.7	—
5 月 末	14,542	7.5	38,041.49	7.9	97.0	—
6 月 末	15,455	14.2	40,502.35	14.9	93.9	—
7 月 末	15,483	14.4	40,572.98	15.1	97.0	—
8 月 末	15,693	16.0	41,220.48	16.9	96.8	—
9 月 末	15,314	13.2	40,162.19	13.9	96.7	—
10 月 末	15,328	13.3	40,317.54	14.3	96.8	—
11 月 末	15,983	18.1	42,103.88	19.4	96.5	—
12 月 末	15,818	16.9	41,592.54	18.0	96.2	—
(期 末) 2024年 1 月 26 日	16,172	19.5	42,305.98	20.0	96.1	—

(注) 騰落率は期首比。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第14期：2023年1月27日～2024年1月26日

当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第14期首	13,531円
第14期末	16,172円
既払分配金	0円
騰落率	19.5%

※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19.5%の上昇となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（20.0%）を0.5%下回りました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

第14期：2023年1月27日～2024年1月26日

投資環境について

▶ 債券市況

新興国の現地通貨建て債券市況は上昇しました。

新興国の現地通貨建て債券市況は、欧米中央銀行による利上げの打ち止め観測などから市場参加者のリスク回避姿勢が後退したことや利金が相応に積みあがったことで上昇しました。

▶ 為替市況

期間の初めに比べてトルコリラなど一部を除き、大半の新興国通貨が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

▶ 三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド

資産のほぼ全額をマザーファンドに投資したことにより、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

▶ 新興国債券インデックスマザーファンド

新興国の現地通貨建ての公社債を主要投

資対象とし、ベンチマークであるJPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。

ベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

▶ 三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド

ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.5\%$ 程度となりました。

マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は $\Delta 0.5\%$ 程度でした。

マザーファンド保有による要因

マザーファンド保有による影響は 0.0% 程度でした。

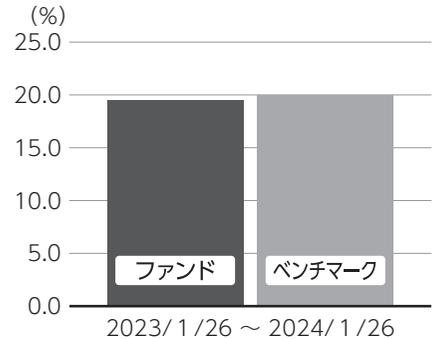
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：評価時価差異要因^{*}によるものです。

^{*}ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

基準価額 (ベビーファンド) とベンチマークの対比 (騰落率)



分配金について

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

分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第14期 2023年1月27日～2024年1月26日
当期分配金（対基準価額比率）	-（-%）
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	9,986

(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 DC新興国債券インデックスファンド**
マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ **新興国債券インデックスマザーファンド**
ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2023年1月27日～2024年1月26日

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	56	0.374	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (期中の日数 ÷ 年間日数)
(投 信 会 社)	(26)	(0.173)	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)	(26)	(0.173)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(4)	(0.027)	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	13	0.089	(b) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(12)	(0.078)	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)	(1)	(0.004)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
(そ の 他)	(1)	(0.007)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	69	0.463	

期中の平均基準価額は、14,974円です。

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

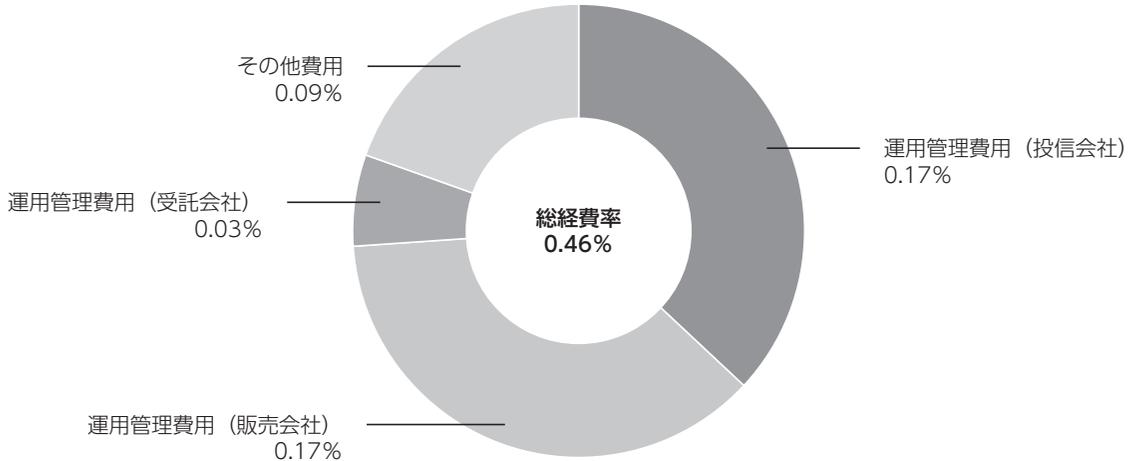
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

(参考情報)

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.46%**です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

○売買及び取引の状況

(2023年1月27日～2024年1月26日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
新興国債券インデックスマザーファンド	千口 1,946,481	千円 3,183,360	千口 424,661	千円 698,623

○利害関係人との取引状況等

(2023年1月27日～2024年1月26日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド>

該当事項はございません。

<新興国債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		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	%	
為替先物取引	291	26.5	311	214	68.8	
為替直物取引	23,449	37.2	14,195	4,723	33.3	

平均保有割合 24.4%

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

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

○組入資産の明細

(2024年1月26日現在)

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
新興国債券インデックスマザーファンド	千口 10,546,062	千口 12,067,881	千円 21,386,700

○投資信託財産の構成

(2024年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
新興国債券インデックスマザーファンド	千円 21,386,700	% 99.4
コール・ローン等、その他	127,425	0.6
投資信託財産総額	21,514,125	100.0

(注) 新興国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨純資産(87,774,883千円)の投資信託財産総額(87,814,026千円)に対する比率は100.0%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=147.70円	1 アルゼンチンペソ=0.1793円	1 メキシコペソ=8.5875円	1 ブラジルリアル=30.013円
100 チリペソ=16.2275円	100 コロンビアペソ=3.7444円	1 ペルーヌエボソル=39.1979円	1 ウルグアイペソ=3.7866円
1 ドミニカペソ=2.5074円	1 ユーロ=160.17円	1 セルビアディナール=1.365564円	1 トルコリラ=4.8773円
1 チェココルナ=6.4751円	100 ハンガリーフォリント=41.5891円	1 ポーランドズロチ=36.6078円	1 ルーマニアレイ=32.1801円
1 マレーシアリンギット=31.1638円	1 タイバーツ=4.14円	1 フィリピンペソ=2.6116円	100 インドネシアルピア=0.94円
1 中国元=20.5768円	1 エジプトポンド=4.7772円	1 南アフリカランド=7.82円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	21,514,125,346
コール・ローン等	86,180,514
新興国債券インデックスマザーファンド(評価額)	21,386,700,058
未収入金	41,244,774
(B) 負債	123,273,360
未払解約金	84,785,398
未払信託報酬	38,084,752
未払利息	22
その他未払費用	403,188
(C) 純資産総額(A-B)	21,390,851,986
元本	13,226,900,741
次期繰越損益金	8,163,951,245
(D) 受益権総口数	13,226,900,741口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,172円

<注記事項>

- ①期首元本額 11,513,852,095円
 期中追加設定元本額 4,015,457,821円
 期中一部解約元本額 2,302,409,175円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.6172円です。

②分配金の計算過程

項 目	2023年1月27日～ 2024年1月26日
費用控除後の配当等収益額	1,073,745,199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	815,547,481円
収益調整金額	9,583,602,142円
分配準備積立金額	1,736,097,206円
当ファンドの分配対象収益額	13,208,992,028円
1万口当たり収益分配対象額	9,986円
1万口当たり分配金額	—円
収益分配金金額	—円

*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】

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1月27日～2024年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 18,293
受取利息	423
支払利息	△ 18,716
(B) 有価証券売買損益	3,014,115,751
売買益	3,335,389,966
売買損	△ 321,274,215
(C) 信託報酬等	△ 70,512,205
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,943,585,253
(E) 前期繰越損益金	681,804,633
(F) 追加信託差損益金	4,538,561,359
(配当等相当額)	(9,559,494,565)
(売買損益相当額)	(△5,020,933,206)
(G) 計(D+E+F)	8,163,951,245
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	8,163,951,245
追加信託差損益金	4,538,561,359
(配当等相当額)	(9,583,602,142)
(売買損益相当額)	(△5,045,040,783)
分配準備積立金	3,625,389,886

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

新興国債券インデックスマザーファンド

《第14期》決算日2024年1月26日

[計算期間：2023年1月27日～2024年1月26日]

「新興国債券インデックスマザーファンド」は、1月26日に第14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14期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主として対象インデックス（JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース））に採用されている新興国の現地通貨建の公社債に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用して公社債の投資比率が100%を超える場合があります。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引を行うことがあります。
主要運用対象	新興国の現地通貨建での公社債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。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		JPモルガンGBI-EM グローバル・ダイバーシファイド (円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	円	騰落率	(円換算ベース)	騰落率			
10期(2020年1月27日)	14,424	8.8%	34,193.00	9.4%	97.4%	—	百万円 30,520
11期(2021年1月26日)	13,819	△4.2%	32,923.96	△3.7%	97.6%	—	37,779
12期(2022年1月26日)	14,025	1.5%	33,419.11	1.5%	97.5%	—	51,888
13期(2023年1月26日)	14,770	5.3%	35,262.54	5.5%	97.1%	—	64,755
14期(2024年1月26日)	17,722	20.0%	42,305.98	20.0%	96.1%	—	87,744

(注) JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建でのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建でのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）とは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表しているJPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（ドルベース）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 騰 落 率	J P モ ル ガ ン G B I - E M グ ロ ー バ ル ・ ダ イ バ ー シ フ ァ イ ド (円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2023年 1 月 26 日	円 14,770	% —	(円換算ベース) 35,262.54	% —	% 97.1
1 月 末	14,795	0.2	35,423.91	0.5	96.7
2 月 末	14,985	1.5	35,809.02	1.5	96.8
3 月 末	15,215	3.0	36,370.53	3.1	97.1
4 月 末	15,417	4.4	36,860.17	4.5	96.7
5 月 末	15,895	7.6	38,041.49	7.9	97.0
6 月 末	16,898	14.4	40,502.35	14.9	93.9
7 月 末	16,934	14.7	40,572.98	15.1	97.0
8 月 末	17,169	16.2	41,220.48	16.9	96.8
9 月 末	16,760	13.5	40,162.19	13.9	96.7
10 月 末	16,781	13.6	40,317.54	14.3	96.8
11 月 末	17,504	18.5	42,103.88	19.4	96.5
12 月 末	17,329	17.3	41,592.54	18.0	96.3
(期 末) 2024年 1 月 26 日	17,722	20.0	42,305.98	20.0	96.1

(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

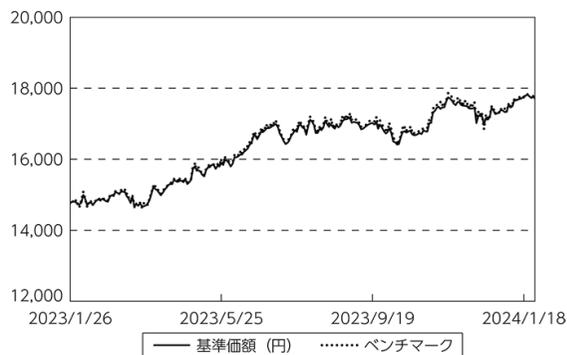
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ20.0%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(20.0%)と同程度となりました。

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

● 投資環境について

◎ 債券市況

新興国の現地通貨建て債券市況は上昇しました。

新興国の現地通貨建て債券市況は、欧米中央銀行による利上げの打ち止め観測などから市場参加者のリスク回避姿勢が後退したことや利金が相応に積みあがったことで上昇しました。

◎ 為替市況

期間の初めに比べてトルコリラなど一部を除き、大半の新興国通貨が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

- ・新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるJPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・ベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは20.0%の上昇になったため、カイ離は0.0%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・評価時価差異要因[※]によるものです。

[※]ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

(主なマイナス要因)

- ・取引要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年1月27日～2024年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 14	% 0.084	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(13)	(0.078)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ そ の 他 ）	(1)	(0.007)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	14	0.084	
期中の平均基準価額は、16,378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。

○利害関係人との取引状況等

(2023年1月27日～2024年1月26日)

利害関係人との取引状況

区 分	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	$\frac{D}{C}$ %
為替先物取引	百万円 291	百万円 77	26.5	百万円 311	百万円 214	68.8
為替直物取引	23,449	8,731	37.2	14,195	4,723	33.3

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

○組入資産の明細

(2024年1月26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
メキシコ	千メキシコペソ 1,061,500	千メキシコペソ 980,804	千円 8,422,655	% 9.6	% —	% 5.2	% 3.0	% 1.4
ブラジル	千ブラジルレアル 323,770	千ブラジルレアル 289,872	8,699,932	9.9	9.9	1.1	5.2	3.6
チリ	千チリペソ 9,825,000	千チリペソ 9,905,170	1,607,361	1.8	—	1.1	0.4	0.3
コロンビア	千コロンビアペソ 113,110,000	千コロンビアペソ 102,382,885	3,833,624	4.4	—	2.9	1.2	0.3
ペルー	千ペルーヌエボソル 50,050	千ペルーヌエボソル 50,215	1,968,325	2.2	—	1.9	0.4	—
ウルグアイ	千ウルグアイペソ 41,000	千ウルグアイペソ 40,464	153,223	0.2	—	0.1	0.0	—
ドミニカ	千ドミニカペソ 48,000	千ドミニカペソ 54,100	135,651	0.2	0.2	0.2	—	—
セルビア	千セルビアディナール 185,000	千セルビアディナール 178,354	243,553	0.3	0.3	0.1	0.1	0.1
トルコ	千トルコリラ 195,300	千トルコリラ 138,622	676,104	0.8	0.8	0.2	0.5	0.1
チェコ	千チェココルナ 856,200	千チェココルナ 817,172	5,291,270	6.0	—	3.2	2.9	—
ハンガリー	千ハンガリーフォリント 7,233,000	千ハンガリーフォリント 6,424,910	2,672,062	3.0	—	1.2	1.3	0.6
ポーランド	千ポーランドズロチ 189,850	千ポーランドズロチ 176,460	6,459,822	7.4	—	2.1	3.4	1.8
ルーマニア	千ルーマニアレイ 103,160	千ルーマニアレイ 100,749	3,242,116	3.7	—	1.9	1.2	0.6
マレーシア	千マレーシアリンギット 269,680	千マレーシアリンギット 272,624	8,496,010	9.7	—	5.5	2.9	1.2
タイ	千タイバーツ 2,006,100	千タイバーツ 2,008,804	8,316,449	9.5	—	5.4	2.5	1.6
フィリピン	千フィリピンペソ 20,000	千フィリピンペソ 18,790	49,074	0.1	—	0.1	—	—
インドネシア	千インドネシアルピア 862,080,000	千インドネシアルピア 898,291,052	8,443,935	9.6	—	7.0	2.2	0.4
中国	千中国元 411,200	千中国元 422,176	8,687,035	9.9	—	4.7	3.8	1.4

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
南アフリカ	千南アフリカランド 1,068,100	千南アフリカランド 884,243	千円 6,914,787	% 7.9	% 7.9	% 6.9	% 1.0	% —
合 計	—	—	84,312,998	96.1	19.0	50.7	32.0	13.3

(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	
メキシコ		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
	国債証券					
	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	68,700	68,301	586,542	2024/12/5
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	15,700	16,601	142,568	2036/11/20
	5 MEXICAN BONOS 250306	5.0	56,000	53,299	457,711	2025/3/6
	5.5 MEXICAN BONOS 270304	5.5	86,200	77,147	662,502	2027/3/4
	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	120,200	111,021	953,400	2026/3/5
	7 MEXICAN BONOS 260903	7.0	27,000	25,332	217,540	2026/9/3
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	98,200	93,032	798,918	2027/6/3
	7.5 MEXICAN BONOS 330526	7.5	68,800	61,343	526,786	2033/5/26
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	108,500	100,118	859,766	2031/5/29
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	24,400	21,874	187,846	2034/11/23
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	81,600	69,936	600,583	2042/11/13
	8 MEXICAN BONOS 240905	8.0	24,000	23,535	202,109	2024/9/5
	8 MEXICAN BONOS 350524	8.0	10,000	9,122	78,338	2035/5/24
	8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	66,400	57,789	496,265	2047/11/7
	8 MEXICAN BONOS 530731	8.0	51,200	44,066	378,419	2053/7/31
	8.5 MEXICAN BONOS 290301	8.5	22,000	21,359	183,421	2029/3/1
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	75,100	73,193	628,546	2029/5/31
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	57,500	53,728	461,389	2038/11/18
小	計				8,422,655	
ブラジル			千ブラジルレアル	千ブラジルレアル		
	国債証券					
	10 (IN)BRAZIL NT 270101	10.0	40,270	40,609	1,218,807	2027/1/1
	10 (IN)BRAZIL NTN 250101	10.0	30,900	31,069	932,498	2025/1/1
	10 (IN)BRAZIL NTN 310101	10.0	12,600	12,378	371,512	2031/1/1
	10 (IN)BRAZIL NTN 330101	10.0	20,700	20,191	606,009	2033/1/1
	10(IN) BRAZIL NTN 290101	10.0	42,300	42,164	1,265,473	2029/1/1
	BRAZIL-LTN 250701	—	33,300	29,156	875,087	2025/7/1
	BRAZIL-LTN 260101	—	52,700	44,027	1,321,382	2026/1/1
	BRAZIL-LTN 260701	—	61,800	49,247	1,478,071	2026/7/1
	BRAZIL-LTN 270701	—	29,200	21,027	631,088	2027/7/1
小	計				8,699,932	
チリ			千チリペソ	千チリペソ		
	国債証券					
	2.3 BONOS TESORER 281001	2.3	480,000	426,360	69,187	2028/10/1
	2.5 BONOS TESORER 250301	2.5	1,860,000	1,817,127	294,874	2025/3/1
	4.5 BONOS TESORER 260301	4.5	1,420,000	1,427,455	231,640	2026/3/1
	4.7 BONOS TESORER 300901	4.7	1,570,000	1,544,016	250,555	2030/9/1
	5 BONOS TESORERIA 281001	5.0	410,000	411,156	66,720	2028/10/1
	5 BONOS TESORERIA 350301	5.0	1,470,000	1,445,018	234,490	2035/3/1
	6 BONOS TESORERIA 330401	6.0	950,000	1,010,712	164,013	2033/4/1
	6 BONOS TESORERIA 430101	6.0	1,315,000	1,424,342	231,135	2043/1/1
	7 BONOS TESORERIA 340501	7.0	350,000	398,982	64,744	2034/5/1
小	計				1,607,361	
コロンビア			千コロンビアペソ	千コロンビアペソ		
	国債証券					
	13.25 TITULOS DE 330209	13.25	7,900,000	9,535,673	357,053	2033/2/9
	5.75 TITULOS DE T 271103	5.75	6,900,000	6,203,379	232,279	2027/11/3

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		
コロンビア		%	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ	千円	
国債証券	6 TITULOS DE TESO 280428	6.0	11,980,000	10,729,133	401,741	2028/4/28
	6.25 TITULOS DE T 251126	6.25	6,690,000	6,428,670	240,715	2025/11/26
	6.25 TITULOS DE T 360709	6.25	4,900,000	3,669,331	137,394	2036/7/9
	7 TITULOS DE TESO 310326	7.0	12,080,000	10,662,043	399,229	2031/3/26
	7 TITULOS DE TESO 320630	7.0	11,700,000	10,020,114	375,193	2032/6/30
	7.25 TITULOS DE T 341018	7.25	10,000,000	8,419,269	315,251	2034/10/18
	7.25 TITULOS DE T 501026	7.25	9,400,000	7,008,575	262,429	2050/10/26
	7.5 TITULOS DE TE 260826	7.5	11,120,000	10,751,066	402,562	2026/8/26
	7.75 TITULOS DE T 300918	7.75	8,340,000	7,754,790	290,370	2030/9/18
	9.25 TITULOS DE T 420528	9.25	12,100,000	11,200,835	419,404	2042/5/28
小計					3,833,624	
ペルー			千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル		
国債証券	5.35 PERU 400812	5.35	3,250	2,784	109,158	2040/8/12
	5.4 PERU 340812	5.4	5,200	4,716	184,884	2034/8/12
	5.94 PERU 290212	5.94	6,600	6,728	263,761	2029/2/12
	6.15 PERU 320812	6.15	6,900	6,783	265,888	2032/8/12
	6.35 PERU 280812	6.35	4,900	5,105	200,141	2028/8/12
	6.9 PERU 370812	6.9	7,000	7,039	275,933	2037/8/12
	6.95 PERU 310812	6.95	6,800	7,098	278,264	2031/8/12
	7.3 PERU 330812	7.3	6,400	6,740	264,220	2033/8/12
	8.2 PERU 260812	8.2	3,000	3,216	126,073	2026/8/12
小計					1,968,325	
ウルグアイ			千ウルグアイペソ	千ウルグアイペソ		
国債証券	8.25 URUGUAY 310521	8.25	17,000	16,150	61,156	2031/5/21
	8.5 URUGUAY (GL) 280315	8.5	7,000	6,761	25,602	2028/3/15
	9.75 URUGUAY 330720	9.75	17,000	17,552	66,464	2033/7/20
小計					153,223	
ドミニカ			千ドミニカペソ	千ドミニカペソ		
国債証券	11.25 DOMINICAN 350915	11.25	32,000	34,604	86,767	2035/9/15
	13.625 DOMINICAN 330203	13.625	16,000	19,495	48,883	2033/2/3
小計					135,651	
セルビア			千セルビアディナール	千セルビアディナール		
国債証券	4.5 SERBIA TREASU 260111	4.5	61,000	60,351	82,413	2026/1/11
	4.5 SERBIA TREASU 320820	4.5	74,000	66,877	91,325	2032/8/20
	5.875 SERBIA TREA 280208	5.875	50,000	51,125	69,814	2028/2/8
小計					243,553	
トルコ			千トルコリラ	千トルコリラ		
国債証券	10.5 TURKEY GOVT 270811	10.5	23,900	15,570	75,943	2027/8/11
	10.6 TURKEY GOVT 260211	10.6	9,600	6,412	31,277	2026/2/11
	11 TURKEY GOVT 270224	11.0	4,500	2,866	13,980	2027/2/24
	11.7 TURKEY GOVT 301113	11.7	14,100	9,038	44,081	2030/11/13
	12.4 TURKEY GOVT 280308	12.4	29,100	19,409	94,666	2028/3/8
	12.6 TURKEY GOVT 251001	12.6	14,600	10,077	49,151	2025/10/1
	16.9 TURKEY GOVT 260902	16.9	17,200	12,805	62,455	2026/9/2
	17.3 TURKEY GOVT 280719	17.3	48,000	36,816	179,562	2028/7/19

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		
トルコ		%	千トルコリラ	千トルコリラ	千円		
	国債証券	17.8 TURKEY GOVT 330713	17.8	28,000	20,888	101,877	2033/7/13
		8 TURKEY GOVT 250312	8.0	6,300	4,737	23,106	2025/3/12
小	計					676,104	
チェコ			千チェココルナ	千チェココルナ			
	国債証券	0.05 CZECH REPubL 291129	0.05	83,000	66,888	433,111	2029/11/29
		0.25 CZECH REPubL 270210	0.25	143,500	128,822	834,140	2027/2/10
		1.5 CZECH REPubL 400424	1.5	20,500	14,391	93,183	2040/4/24
		1.75 CZECH REPubL 320623	1.75	119,200	101,267	655,717	2032/6/23
		1.95 CZECH REPubL 370730	1.95	24,300	19,183	124,217	2037/7/30
		3.5 CZECH REPubL 350530	3.5	81,500	78,158	506,084	2035/5/30
		4.5 CZECH REPubL 321111	4.5	21,000	21,897	141,790	2032/11/11
		4.9 CZECH REPubL 340414	4.9	32,000	34,561	223,789	2034/4/14
		5 CZECH REPubL 300930	5.0	79,700	84,992	550,337	2030/9/30
		5.5 CZECH REPubL 281212	5.5	108,000	116,316	753,157	2028/12/12
		6 CZECH REPubL 260226	6.0	138,500	144,923	938,393	2026/2/26
		6.2 CZECH REPubL 310616	6.2	5,000	5,768	37,348	2031/6/16
小	計					5,291,270	
ハンガリー			千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント			
	国債証券	1 HUNGARY 251126	1.0	427,000	392,248	163,132	2025/11/26
		1.5 HUNGARY 260422	1.5	560,000	511,196	212,601	2026/4/22
		1.5 HUNGARY 260826	1.5	270,000	241,683	100,514	2026/8/26
		2 HUNGARY 290523	2.0	330,000	274,543	114,180	2029/5/23
		2.25 HUNGARY 330420	2.25	505,000	376,277	156,490	2033/4/20
		2.25 HUNGARY 340622	2.25	150,000	108,870	45,278	2034/6/22
		2.5 HUNGARY 241024	2.5	290,000	281,453	117,054	2024/10/24
		2.75 HUNGARY 261222	2.75	373,000	341,340	141,960	2026/12/22
		3 HUNGARY 271027	3.0	541,000	491,868	204,563	2027/10/27
		3 HUNGARY 300821	3.0	518,000	440,245	183,094	2030/8/21
		3 HUNGARY 381027	3.0	392,000	271,885	113,074	2038/10/27
		3 HUNGARY 410425	3.0	205,000	136,058	56,585	2041/4/25
		3.25 HUNGARY 311022	3.25	618,000	520,870	216,625	2031/10/22
		4.5 HUNGARY 280323	4.5	360,000	343,131	142,705	2028/3/23
		4.75 HUNGARY 321124	4.75	440,000	405,064	168,462	2032/11/24
		5.5 HUNGARY 250624	5.5	492,000	489,581	203,612	2025/6/24
		6.75 HUNGARY 281022	6.75	582,000	603,613	251,037	2028/10/22
		9.5 HUNGARY 261021	9.5	180,000	194,978	81,089	2026/10/21
小	計					2,672,062	
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ			
	国債証券	0 POLAND 251025	—	10,700	9,849	360,586	2025/10/25
		0.25 POLAND 261025	0.25	12,200	10,750	393,553	2026/10/25
		0.75 POLAND 250425	0.75	12,500	11,876	434,786	2025/4/25
		1.25 POLAND 301025	1.25	15,100	11,808	432,299	2030/10/25
		1.75 POLAND 320425	1.75	14,100	10,853	397,309	2032/4/25
		2.25 POLAND 241025	2.25	8,500	8,332	305,045	2024/10/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	17,000	16,027	586,749	2026/7/25

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		
ポーランド		%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ			
	国債証券	2.5 POLAND 270725	2.5	10,900	10,044	367,689	2027/7/25
		2.75 POLAND 280425	2.75	14,750	13,467	493,021	2028/4/25
		2.75 POLAND 291025	2.75	17,200	15,233	557,661	2029/10/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	14,500	14,135	517,471	2025/7/25
		3.75 POLAND 270525	3.75	12,900	12,413	454,444	2027/5/25
		6 POLAND 331025	6.0	12,500	13,087	479,116	2033/10/25
		7.5 POLAND 280725	7.5	17,000	18,577	680,087	2028/7/25
小	計					6,459,822	
ルーマニア			千ルーマニアレイ	千ルーマニアレイ			
	国債証券	2.5 ROMANIA GOVER 271025	2.5	4,000	3,535	113,763	2027/10/25
		3.25 ROMANIA GOVE 260624	3.25	3,200	3,020	97,214	2026/6/24
		3.5 ROMANIA GOVER 251125	3.5	4,500	4,326	139,237	2025/11/25
		3.65 ROMANIA GOVE 250728	3.65	4,000	3,887	125,095	2025/7/28
		3.65 ROMANIA GOVE 310924	3.65	5,500	4,634	149,143	2031/9/24
		3.7 ROMANIA GOVER 241125	3.7	1,000	984	31,671	2024/11/25
		4.15 ROMANIA GOVE 280126	4.15	5,200	4,848	156,019	2028/1/26
		4.15 ROMANIA GOVE 301024	4.15	5,000	4,437	142,812	2030/10/24
		4.25 ROMANIA GOVE 360428	4.25	3,800	3,122	100,484	2036/4/28
		4.75 ROMANIA GOVE 250224	4.75	6,900	6,816	219,356	2025/2/24
		4.75 ROMANIA GOVE 341011	4.75	5,200	4,548	146,356	2034/10/11
		4.85 ROMANIA GOVE 260422	4.85	4,900	4,787	154,071	2026/4/22
		4.85 ROMANIA GOVE 290725	4.85	4,800	4,498	144,761	2029/7/25
		5 ROMANIA GOVERN 290212	5.0	6,260	5,936	191,037	2029/2/12
		5.8 ROMANIA GOV 270726	5.8	5,800	5,746	184,928	2027/7/26
		6.7 ROMANIA GOVER 320225	6.7	5,900	6,039	194,364	2032/2/25
		7.2 ROMANIA GOVER 261028	7.2	3,200	3,299	106,167	2026/10/28
		7.2 ROMANIA GOVER 270531	7.2	1,500	1,551	49,935	2027/5/31
		7.2 ROMANIA GOVER 331030	7.2	2,200	2,321	74,713	2033/10/30
		7.35 ROMANIA GOVE 310428	7.35	2,800	2,954	95,063	2031/4/28
		7.9 ROMANIA GOVER 380224	7.9	3,900	4,425	142,400	2038/2/24
		8 ROMANIA GOVERN 300429	8.0	2,900	3,145	101,227	2030/4/29
		8.25 ROMANIA GOVE 320929	8.25	5,200	5,825	187,479	2032/9/29
		8.75 ROMANIA GOVE 281030	8.75	5,500	6,053	194,811	2028/10/30
小	計					3,242,116	
マレーシア			千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット			
	国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	2.632	21,700	20,180	628,900	2031/4/15
		3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	14,600	14,599	454,984	2027/5/31
		3.582 MALAYSIAGOV 320715	3.582	14,700	14,398	448,704	2032/7/15
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	11,450	11,500	358,402	2028/6/15
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	3.757	13,700	13,185	410,906	2040/5/22
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	3.828	11,570	11,540	359,647	2034/7/5
		3.882 MALAYSIAGOV 250314	3.882	8,400	8,456	263,523	2025/3/14
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	25,550	25,830	804,975	2029/8/15
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	13,200	13,357	416,267	2027/11/16
		3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	10,720	10,847	338,038	2026/11/30

銘柄	当期末						償還年月日
	利率	額面金額	評価額		債還年月日		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
マレーシア		%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円		
国債証券	3.906 MALAYSIA GOV 260715	3.906	19,100	19,320	602,089	2026/7/15	
	3.955 MALAYSIA GOV 250915	3.955	25,600	25,819	804,633	2025/9/15	
	4.065 MALAYSIA GOV 500615	4.065	9,400	9,149	285,132	2050/6/15	
	4.254 MALAYSIA GOV 350531	4.254	9,550	9,803	305,517	2035/5/31	
	4.369 MALAYSIA IN 281031	4.369	12,800	13,210	411,693	2028/10/31	
	4.457 MALAYSIA GOV 530331	4.457	3,400	3,528	109,960	2053/3/31	
	4.504 MALAYSIA GOV 290430	4.504	2,800	2,913	90,790	2029/4/30	
	4.696 MALAYSIA GOV 421015	4.696	14,740	15,889	495,175	2042/10/15	
	4.762 MALAYSIA GOV 370407	4.762	12,400	13,346	415,914	2037/4/7	
	4.893 MALAYSIA GOV 380608	4.893	8,200	9,003	280,578	2038/6/8	
	4.921 MALAYSIA GOV 480706	4.921	6,100	6,744	210,172	2048/7/6	
小計					8,496,010		
タイ			千タイバーツ	千タイバーツ			
国債証券	0.75 THAILAND 240917	0.75	51,300	50,787	210,261	2024/9/17	
	0.95 THAILAND 250617	0.95	89,000	87,371	361,717	2025/6/17	
	1 THAILAND 270617	1.0	114,200	109,229	452,210	2027/6/17	
	1.45 THAILAND 241217	1.45	120,600	119,656	495,376	2024/12/17	
	1.585 THAILAND 351217	1.585	78,900	69,521	287,820	2035/12/17	
	1.6 THAILAND 291217	1.6	90,700	86,364	357,550	2029/12/17	
	1.6 THAILAND 350617	1.6	38,200	33,966	140,621	2035/6/17	
	2 THAILAND 311217	2.0	127,900	122,346	506,513	2031/12/17	
	2 THAILAND 420617	2.0	57,500	49,027	202,975	2042/6/17	
	2.125 THAILAND 261217	2.125	96,300	95,754	396,421	2026/12/17	
	2.25 THAILAND 270317	2.25	45,800	45,680	189,117	2027/3/17	
	2.35 THAILAND 260617	2.35	95,300	95,380	394,877	2026/6/17	
	2.4 THAILAND 290317	2.4	38,000	37,936	157,057	2029/3/17	
	2.65 THAILAND 280617	2.65	98,600	99,633	412,481	2028/6/17	
	2.875 THAILAND 281217	2.875	84,900	86,703	358,954	2028/12/17	
	2.875 THAILAND 460617	2.875	67,200	62,004	256,700	2046/6/17	
	3.3 THAILAND 380617	3.3	97,000	101,761	421,293	2038/6/17	
	3.35 THAILAND 330617	3.35	88,800	93,473	386,978	2033/6/17	
	3.39 THAILAND 370617	3.39	72,900	77,231	319,737	2037/6/17	
	3.4 THAILAND 360617	3.4	74,000	78,150	323,545	2036/6/17	
	3.45 THAILAND 430617	3.45	61,300	64,329	266,325	2043/6/17	
	3.65 THAILAND 310620	3.65	78,100	83,903	347,359	2031/6/20	
	3.775 THAILAND 320625	3.775	88,600	96,191	398,231	2032/6/25	
	3.85 THAILAND 251212	3.85	74,700	76,778	317,861	2025/12/12	
	4.875 THAILAND 290622	4.875	76,300	85,618	354,458	2029/6/22	
小計					8,316,449		
フィリピン			千フィリピンペソ	千フィリピンペソ			
国債証券	6.25 PHILIPPI (GL) 360114	6.25	20,000	18,790	49,074	2036/1/14	
小計					49,074		
インドネシア			千インドネシアルピア	千インドネシアルピア			
国債証券	10.5 INDONESIA 300815	10.5	7,050,000	8,520,344	80,091	2030/8/15	
	11 INDONESIA 250915	11.0	8,250,000	8,842,395	83,118	2025/9/15	

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	
インドネシア		%	千インドネシアルピア	千インドネシアルピア	千円	
	国債証券	5.125	31,300,000	30,244,003	284,293	2027/4/15
		5.5	44,700,000	44,110,236	414,636	2026/4/15
		6.125	29,000,000	28,733,610	270,095	2028/5/15
		6.25	12,000,000	11,613,626	109,168	2036/6/15
		6.375	25,000,000	24,911,999	234,172	2028/8/15
		6.375	48,200,000	47,564,546	447,106	2032/4/15
		6.375	4,000,000	3,922,448	36,871	2037/7/15
		6.5	29,900,000	29,962,790	281,650	2025/6/15
		6.5	47,600,000	47,072,019	442,476	2031/2/15
		6.625	24,400,000	24,278,000	228,213	2033/5/15
		6.625	11,500,000	11,500,460	108,104	2034/2/15
		6.875	9,000,000	9,144,180	85,955	2029/4/15
		7.0	32,450,000	33,119,242	311,320	2027/5/15
		7.0	44,700,000	45,797,358	430,495	2030/9/15
		7.0	41,100,000	42,214,722	396,818	2033/2/15
		7.125	13,700,000	14,175,253	133,247	2038/6/15
		7.125	30,600,000	31,303,800	294,255	2042/6/15
		7.125	13,500,000	13,828,252	129,985	2043/6/15
		7.5	8,400,000	8,823,564	82,941	2032/8/15
		7.5	44,800,000	47,663,280	448,034	2035/6/15
		7.5	23,200,000	24,687,952	232,066	2038/5/15
		7.5	29,400,000	31,202,937	293,307	2040/4/15
		8.25	35,200,000	37,993,996	357,143	2029/5/15
		8.25	19,000,000	20,845,281	195,945	2032/6/15
		8.25	26,600,000	29,966,855	281,688	2036/5/15
		8.375	38,930,000	40,895,237	384,415	2026/9/15
		8.375	46,700,000	52,586,007	494,308	2034/3/15
		8.375	23,200,000	26,529,220	249,374	2039/4/15
		8.75	18,400,000	20,638,838	194,005	2031/5/15
		9.0	24,600,000	27,261,970	256,262	2029/3/15
		9.5	15,700,000	18,336,621	172,364	2031/7/15
小 計					8,443,935	
中国			千中国元	千中国元		
	国債証券	1.99	14,000	13,975	287,567	2025/4/9
		2.18	3,000	2,999	61,718	2025/8/25
		2.18	8,000	7,990	164,421	2026/8/15
		2.24	3,000	3,002	61,789	2025/5/25
		2.26	6,000	6,010	123,684	2025/2/24
		2.28	4,000	4,006	82,451	2025/11/25
		2.3	5,000	5,005	102,997	2026/5/15
		2.37	8,000	8,025	165,142	2027/1/20
		2.4	5,000	5,002	102,932	2028/7/15
		2.44	5,000	5,018	103,267	2027/10/15
		2.46	8,000	8,041	165,458	2026/2/15
		2.48	5,000	5,020	103,313	2027/4/15

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		
%	千中国元	千中国元	千円				
中国	国債証券	2.48 CHINA GOVT 280925	2.48	3,000	3,014	62,033	2028/9/25
		2.5 CHINA GOVT 270725	2.5	7,000	7,039	144,845	2027/7/25
		2.52 CHINA GOVT 330825	2.52	9,000	8,985	184,885	2033/8/25
		2.55 CHINA GOVT 281015	2.55	6,000	6,055	124,612	2028/10/15
		2.6 CHINA GOVT 300915	2.6	7,000	7,051	145,105	2030/9/15
		2.6 CHINA GOVT 320901	2.6	6,000	6,016	123,795	2032/9/1
		2.62 CHINA GOVT 280415	2.62	7,000	7,084	145,778	2028/4/15
		2.62 CHINA GOVT 290925	2.62	6,000	6,062	124,751	2029/9/25
		2.62 CHINA GOVT 300625	2.62	5,000	5,040	103,713	2030/6/25
		2.64 CHINA GOVT 280115	2.64	7,000	7,080	145,701	2028/1/15
		2.67 CHINA GOVT 330525	2.67	8,000	8,077	166,213	2033/5/25
		2.67 CHINA GOVT 331125	2.67	7,000	7,090	145,905	2033/11/25
		2.68 CHINA GOVT 300521	2.68	16,000	16,194	333,226	2030/5/21
		2.69 CHINA GOVT 260812	2.69	10,000	10,112	208,073	2026/8/12
		2.69 CHINA GOVT 320815	2.69	7,000	7,074	145,572	2032/8/15
		2.75 CHINA GOVT 290615	2.75	3,000	3,053	62,829	2029/6/15
		2.75 CHINA GOVT 320217	2.75	7,000	7,117	146,449	2032/2/17
		2.76 CHINA GOVT 320515	2.76	5,000	5,082	104,590	2032/5/15
		2.79 CHINA GOVT 291215	2.79	4,000	4,076	83,881	2029/12/15
		2.8 CHINA GOVT 290324	2.8	2,000	2,040	41,977	2029/3/24
		2.8 CHINA GOVT 300325	2.8	4,000	4,074	83,841	2030/3/25
		2.8 CHINA GOVT 321115	2.8	6,000	6,112	125,770	2032/11/15
		2.85 CHINA GOVT 270604	2.85	12,000	12,214	251,331	2027/6/4
		2.88 CHINA GOVT 330225	2.88	7,000	7,195	148,067	2033/2/25
		2.89 CHINA GOVT 311118	2.89	5,000	5,136	105,688	2031/11/18
		2.91 CHINA GOVT 281014	2.91	4,000	4,100	84,367	2028/10/14
		2.94 CHINA GOVT 241017	2.94	4,000	4,026	82,848	2024/10/17
		3 CHINA GOVT 531015	3.0	1,000	1,057	21,767	2053/10/15
		3.01 CHINA GOVT 280513	3.01	12,000	12,348	254,095	2028/5/13
		3.02 CHINA GOVT 251022	3.02	15,000	15,238	313,556	2025/10/22
		3.02 CHINA GOVT 310527	3.02	10,000	10,349	212,965	2031/5/27
		3.03 CHINA GOVT 260311	3.03	7,000	7,131	146,752	2026/3/11
		3.12 CHINA GOVT 261205	3.12	7,000	7,180	147,745	2026/12/5
		3.12 CHINA GOVT 521025	3.12	4,000	4,246	87,385	2052/10/25
		3.13 CHINA GOVT 291121	3.13	14,000	14,557	299,539	2029/11/21
		3.19 CHINA GOVT 530415	3.19	4,000	4,356	89,643	2053/4/15
		3.22 CHINA GOVT 251206	3.22	9,000	9,188	189,075	2025/12/6
		3.25 CHINA GOVT 260606	3.25	12,200	12,517	257,578	2026/6/6
		3.25 CHINA GOVT 281122	3.25	10,000	10,448	215,005	2028/11/22
		3.27 CHINA GOVT 301119	3.27	10,000	10,530	216,689	2030/11/19
		3.28 CHINA GOVT 271203	3.28	11,000	11,438	235,370	2027/12/3
		3.29 CHINA GOVT 290523	3.29	15,000	15,712	323,303	2029/5/23
		3.32 CHINA GOVT 520415	3.32	5,000	5,546	114,137	2052/4/15
		3.53 CHINA GOVT 511018	3.53	4,000	4,566	93,956	2051/10/18
		3.72 CHINA GOVT 510412	3.72	5,000	5,929	122,001	2051/4/12

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		
中国		%	千中国元	千中国元	千円	
国債証券	3.81 CHINA GOVT 500914	3.81	8,000	9,518	195,861	2050/9/14
小 計					8,687,035	
南アフリカ			千南アフリカランド	千南アフリカランド		
国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	10.5	105,600	110,388	863,241	2026/12/21
	11.625 SOUTH AFRI 530331	11.625	12,200	11,615	90,837	2053/3/31
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	39,800	26,238	205,182	2036/3/31
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	35,300	21,326	166,773	2041/2/28
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	71,000	59,629	466,301	2031/2/28
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	135,300	125,003	977,528	2030/1/31
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	120,700	105,389	824,143	2032/3/31
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	103,400	80,838	632,154	2037/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	97,200	71,947	562,628	2044/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	146,200	107,530	840,885	2048/2/28
	8.875 SOUTH AFRI 350228	8.875	112,500	94,950	742,509	2035/2/28
	9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	88,900	69,386	542,602	2040/1/31
小 計					6,914,787	
合 計					84,312,998	

(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。

○投資信託財産の構成

(2024年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 84,312,998	% 96.0
コール・ローン等、その他	3,501,028	4.0
投資信託財産総額	87,814,026	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(87,774,883千円)の投資信託財産総額(87,814,026千円)に対する比率は100.0%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=147.70円	1 アルゼンチンペソ=0.1793円	1 メキシコペソ=8.5875円	1 ブラジルリアル=30.013円
100チリペソ=16.2275円	100コロンビアペソ=3.7444円	1ペルーヌエボソル=39.1979円	1ウルグアイペソ=3.7866円
1ドミニカペソ=2.5074円	1ユーロ=160.17円	1セルビアディナール=1.365564円	1トルコリラ=4.8773円
1チェココルナ=6.4751円	100ハンガリーフォリント=41.5891円	1ポーランドズロチ=36.6078円	1ルーマニアレイ=32.1801円
1マレーシアリングギット=31.1638円	1タイバーツ=4.14円	1フィリピンペソ=2.6116円	100インドネシアルピア=0.94円
1中国元=20.5768円	1エジプトポンド=4.7772円	1南アフリカランド=7.82円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	88,052,622,459
コール・ローン等	1,951,476,741
公社債(評価額)	84,312,998,200
未収入金	433,928,679
未収利息	1,238,196,857
前払費用	116,021,982
(B) 負債	308,428,946
前受収益	188,001
未払金	242,940,331
未払解約金	65,300,606
未払利息	8
(C) 純資産総額(A-B)	87,744,193,513
元本	49,510,869,131
次期繰越損益金	38,233,324,382
(D) 受益権総口数	49,510,869,131口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,722円

○損益の状況 (2023年1月27日～2024年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,640,990,668
受取利息	4,640,123,564
その他収益金	909,215
支払利息	△ 42,111
(B) 有価証券売買損益	9,156,655,910
売買益	10,394,871,164
売買損	△ 1,238,215,254
(C) 保管費用等	△ 64,590,944
(D) 当期損益金(A+B+C)	13,733,055,634
(E) 前期繰越損益金	20,913,429,981
(F) 追加信託差損益金	4,767,238,004
(G) 解約差損益金	△ 1,180,399,237
(H) 計(D+E+F+G)	38,233,324,382
次期繰越損益金(H)	38,233,324,382

<注記事項>

- ①期首元本額 43,842,059,667円
 期中追加設定元本額 7,525,241,433円
 期中一部解約元本額 1,856,431,969円
 また、1口当たり純資産額は、期末17,722円です。

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
 (注) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

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)

eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	17,019,451,149円
三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド	12,067,881,762円
つみたて8資産均等バランス	8,379,537,851円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	3,418,521,516円
eMAXIS 新興国債券インデックス	3,108,700,752円
ラップ向けインデックスf 新興国債券	2,179,237,577円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,185,760,687円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	540,095,515円
海外債券セレクション(ラップ向け)	521,700,608円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	429,232,924円
eMAXIS バランス(波乗り型)	305,210,639円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	204,942,771円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	90,816,773円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	36,342,096円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	10,364,781円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	6,099,084円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,834,032円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	1,617,811円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,520,803円
合計	49,510,869,131円

[お知らせ]

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)