

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成29年10月13日
【計算期間】	第2期中（自平成29年1月17日 至平成29年7月16日）
【ファンド名】	世界プレミアム企業債券ファンド（為替ヘッジあり）
【発行者名】	三菱UFJ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松田 通
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【連絡場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【電話番号】	03-6250-4740
【縦覧に供する場所】	該当ありません

（注）この半期報告書は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第7条第4項の規定により、平成29年4月14日付をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書とみなされます。

1【ファンドの運用状況】

(1)【投資状況】

【投資状況】

平成29年7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	9,920,328,917	98.48
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		153,052,870	1.52
純資産総額		10,073,381,787	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

【投資資産】

(a)【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

平成29年7月31日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	口数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	世界プレミアム企業債券マザー ファンド	親投資信託 受益証券		10,013,454,040	0.9688 0.9907	9,701,939,443 9,920,328,917		98.48

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類/業種別投資比率

平成29年7月31日現在

種類/業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.48
合計	98.48

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

(b)【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(c)【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(2)【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成29年7月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額	基準価額 (1万口当たりの純資産価額)
第1計算期間末日 (平成29年1月16日)	6,002,690,034 (分配付) 5,996,795,739 (分配落)	10,184 (分配付) 10,174 (分配落)
平成28年7月末日	6,200,084,881	10,347
8月末日	6,243,513,074	10,377
9月末日	6,602,653,443	10,374
10月末日	6,342,276,034	10,285
11月末日	5,934,943,993	10,165
12月末日	6,099,041,375	10,194
平成29年1月末日	5,968,123,082	10,152
2月末日	5,959,374,292	10,269
3月末日	5,715,408,132	10,223
4月末日	5,781,161,322	10,288
5月末日	6,597,304,282	10,335
6月末日	8,288,743,193	10,297
7月末日	10,073,381,787	10,346

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	10円

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	1.84
第1計算期間末日から 平成29年7月末日までの期間	1.69

（注）「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額）を控除した額を当該基準価額（分配落の額）で除して得た数に100を乗じて得た数をいう。ただし、第1計算期間末日から平成29年7月末日までの期間については平成29年7月末日の基準価額から当該基準価額（分配落の額）を控除した額を当該基準価額（分配落の額）で除して得た数に100を乗じて得た数をいう。

< 参考 >

「世界プレミアム企業債券マザーファンド」
投資状況

平成29年7月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	486,305,119	4.90
	ドイツ	150,943,981	1.52
特殊債券	アメリカ	69,199,863	0.70
社債券	アメリカ	6,151,539,975	62.01
	イギリス	694,070,250	7.00
	オランダ	590,873,703	5.96
	ルクセンブルグ	253,186,808	2.55
	オーストラリア	157,318,262	1.59
	ドイツ	121,075,887	1.22
	ベルギー	119,110,362	1.20
	アイルランド	93,698,456	0.94
	ジャージー島	67,438,808	0.68
	パナマ	55,296,762	0.56
	カナダ	55,287,116	0.56
	スペイン	44,291,214	0.45
	フランス	30,078,644	0.30
	イタリア	27,514,478	0.28
スイス	27,454,061	0.28	
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		725,962,579	7.30
純資産総額		9,920,646,328	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

（a）投資有価証券の主要銘柄
a 評価額上位30銘柄

平成29年7月31日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	券面総額	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
アメリカ	1.75 T-NOTE 220531	国債証券		1,850,000.00	10,967.75 11,001.3777	202,903,475 203,525,487	1.750000 2022/05/31	2.05
アメリカ	1.125 PROCTER & G 231102	社債券		1,100,000.00	13,345.96 13,404.8376	146,805,599 147,453,213	1.125000 2023/11/02	1.49
アメリカ	3.35 ROCHE HOLDIN 240930	社債券		1,250,000.00	11,423.57 11,513.5879	142,794,693 143,919,849	3.350000 2024/09/30	1.45
アメリカ	2.125 MICROSOFT C 211206	社債券		1,000,000.00	14,048.48 14,045.8661	140,484,850 140,458,661	2.125000 2021/12/06	1.42
オランダ	0.875 UNILEVER NV 250731	社債券		1,000,000.00	12,919.23 12,918.3260	129,192,335 129,183,260	0.875000 2025/07/31	1.30
アメリカ	1.875 T-NOTE 220228	国債証券		1,100,000.00	11,066.91 11,078.9675	121,736,093 121,868,641	1.875000 2022/02/28	1.23

アメリカ	3.6 HSBC BANK 230525	社債券		1,000,000.00	11,403.45 11,483.6831	114,034,586 114,836,831	3.600000 2023/05/25	1.16
アメリカ	3.373 GE CAPITAL 251115	社債券		1,000,000.00	11,400.02 11,426.2459	114,000,267 114,262,459	3.373000 2025/11/15	1.15
アメリカ	3.043 EXXON MOBIL 260301	社債券		1,000,000.00	11,129.32 11,254.2985	111,293,271 112,542,985	3.043000 2026/03/01	1.13
アメリカ	2.4 APPLE INC 230503	社債券		1,000,000.00	10,995.68 11,054.0464	109,956,822 110,540,464	2.400000 2023/05/03	1.11
アメリカ	1.75 SHELL INTER 210912	社債券		1,000,000.00	10,884.90 10,903.9704	108,849,019 109,039,704	1.750000 2021/09/12	1.10
アメリカ	1.125 MERCK & CO 211015	社債券		750,000.00	13,439.33 13,489.0971	100,795,031 101,168,228	1.125000 2021/10/15	1.02
アメリカ	1.3 HONEYWELL INT 230222	社債券		750,000.00	13,455.46 13,463.8024	100,915,994 100,978,518	1.300000 2023/02/22	1.02
アメリカ	1.25 UNITED TECHN 230522	社債券		750,000.00	13,465.96 13,451.2004	100,994,757 100,884,003	1.250000 2023/05/22	1.02
イギリス	1 LLOYDS BANKING 231109	社債券		750,000.00	12,994.19 13,056.5458	97,456,478 97,924,093	1.000000 2023/11/09	0.99
ルクセンブルグ	1.25 ALLERGAN FUN 240601	社債券		750,000.00	12,958.56 13,036.9816	97,189,270 97,777,362	1.250000 2024/06/01	0.99
オーストラリア	0.625 NATIONAL A 231110	社債券		750,000.00	12,917.61 13,022.4219	96,882,096 97,668,164	0.625000 2023/11/10	0.98
オランダ	1.875 CRH FUNDING 240109	社債券		700,000.00	13,771.42 13,813.4425	96,399,961 96,694,097	1.875000 2024/01/09	0.97
アイルランド	2.125 FRESENIUS F 270201	社債券		700,000.00	13,375.00 13,385.4938	93,625,062 93,698,456	2.125000 2027/02/01	0.94
ドイツ	0 OBL 220408	国債証券		700,000.00	13,087.79 13,133.8431	91,614,540 91,936,902	0.750000 2022/04/08	0.93
オランダ	0.75 ING GROEP NV 220309	社債券		700,000.00	13,020.61 13,087.2729	91,144,338 91,610,910	0.750000 2022/03/09	0.92
アメリカ	3.625 ELECTRICITE 251013	社債券		800,000.00	11,310.73 11,420.5408	90,485,852 91,364,326	3.625000 2025/10/13	0.92
アメリカ	0.75 CITIGROUP 231026	社債券		700,000.00	12,804.03 12,833.8849	89,628,237 89,837,194	0.750000 2023/10/26	0.91
アメリカ	2.375 T-NOTE 270515	国債証券		800,000.00	11,059.13 11,118.6246	88,473,112 88,948,996	2.375000 2027/05/15	0.90
アメリカ	4.25 IMPERIAL BRA 250721	社債券		750,000.00	11,636.47 11,680.7130	87,273,552 87,605,347	4.250000 2025/07/21	0.88
アメリカ	2.875 MICROSOFT C 240206	社債券		750,000.00	11,224.05 11,302.9629	84,180,387 84,772,221	2.875000 2024/02/06	0.85
アメリカ	2.375 MORGAN STA 210331	社債券		600,000.00	13,919.92 13,970.9543	83,519,544 83,825,726	2.375000 2021/03/31	0.84
アメリカ	4.35 JPMORGAN CHA 210815	社債券		700,000.00	11,832.58 11,865.5051	82,828,114 83,058,535	4.350000 2021/08/15	0.84
アメリカ	2.375 CREDIT AGR 210701	社債券		750,000.00	11,016.83 11,070.1023	82,626,272 83,025,767	2.375000 2021/07/01	0.84
アメリカ	2.65 SMBC AVIATIO 210715	社債券		750,000.00	10,924.88 10,996.2450	81,936,613 82,471,838	2.650000 2021/07/15	0.83

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成29年7月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	6.42
特殊債券	0.70
社債券	85.56
合計	92.68

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

(b) 投資不動産物件

該当事項はありません。

(c) その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

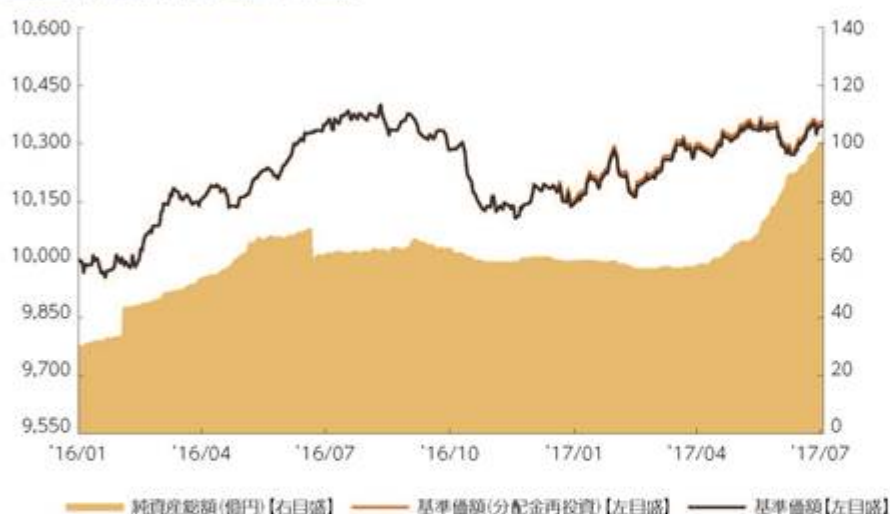
[参考情報]



運用実績

2017年7月31日現在

■基準価額・純資産の推移 2016年1月29日(設定日)～2017年7月31日



- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は10,000を起点として表示
- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	10,346円
純資産総額	100.7億円

■分配の推移

2017年1月	10円
設定来累計	10円

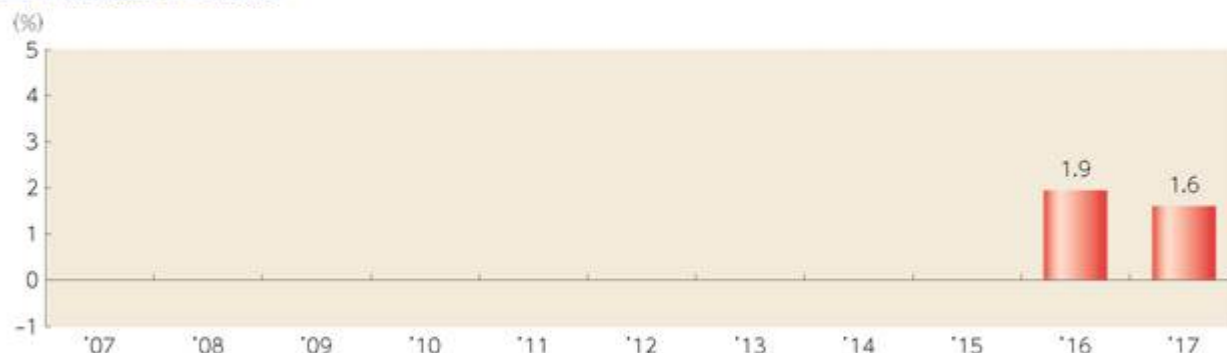
・分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

国・地域別構成	比率	組入上位銘柄	種別	国・地域	比率
アメリカ	66.6%	1 1.75 T-NOTE 220531	国債	アメリカ	2.0%
イギリス	6.9%	2 1.125 PROCTER & G 231102	社債	アメリカ	1.5%
オランダ	5.9%	3 3.35 ROCHE HOLDIN 240930	社債	アメリカ	1.4%
ドイツ	2.7%	4 2.125 MICROSOFT C 211206	社債	アメリカ	1.4%
ルクセンブルグ	2.5%	5 0.875 UNILEVER NV 250731	社債	オランダ	1.3%
オーストラリア	1.6%	6 1.875 T-NOTE 220228	国債	アメリカ	1.2%
ベルギー	1.2%	7 3.6 HSBC BANK 230525	社債	アメリカ	1.1%
アイルランド	0.9%	8 3.373 GE CAPITAL 251115	社債	アメリカ	1.1%
その他	11.7%	9 3.043 EXXON MOBIL 260301	社債	アメリカ	1.1%
合計	100.0%	10 2.4 APPLE INC 230503	社債	アメリカ	1.1%

・各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

■年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2016年は設定日から年末までの、2017年は年初から7月31日までの収益率を表示
- ・ファンドにベンチマークはありません。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。
運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。

【投資リスク】

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。



- 基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
- ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	TOPIX(配当込み)	TOPIX(配当込み)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数(TOPIX)に、現金配当による権利落ちの修正を加えた株価指数です。TOPIX(配当込み)に関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の停止またはTOPIX(配当込み)の商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI(国債)	NOMURA-BPIとは、野村証券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(国債)はそのサブインデックスです。わが国の国債で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI(国債)は野村証券株式会社の知的財産であり、運用成果等に関し、野村証券株式会社は一切関係ありません。
先進国債	シティ世界国債インデックス(除く日本)	シティ世界国債インデックス(除く日本)は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	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。

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

2【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	10,976,993,949	5,082,698,294	5,894,295,655
第2計算期期首から 平成29年7月31日までの期間	5,580,109,590	1,737,996,591	9,736,408,654

3【ファンドの経理状況】

【中間財務諸表】

- 1 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成29年1月17日から平成29年7月16日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

【世界プレミア企業債券ファンド（為替ヘッジあり）】
（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 [平成29年 1月16日現在]	第2期中間計算期間末 [平成29年 7月16日現在]
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	68,050,002
コール・ローン	100,337,616	428,962,748
親投資信託受益証券	5,851,431,169	9,027,501,946
派生商品評価勘定	126,636,198	152,046
未収入金	30,100,650	-
流動資産合計	6,108,505,633	9,524,666,742
資産合計	6,108,505,633	9,524,666,742
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	16,416	210,411,045
未払収益分配金	5,894,295	-
未払解約金	80,593,270	1,444,414
未払受託者報酬	947,878	1,024,583
未払委託者報酬	24,144,202	24,248,499
未払利息	145	1,860
その他未払費用	113,688	122,887
流動負債合計	111,709,894	237,253,288
負債合計	111,709,894	237,253,288
純資産の部		
元本等		
元本	5,894,295,655	9,019,355,201
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	102,500,084	268,058,253
（分配準備積立金）	76,888,214	59,229,036
元本等合計	5,996,795,739	9,287,413,454
純資産合計	5,996,795,739	9,287,413,454
負債純資産合計	6,108,505,633	9,524,666,742

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期中間計算期間 自 平成28年 1月29日 至 平成28年 7月28日	第2期中間計算期間 自 平成29年 1月17日 至 平成29年 7月16日
営業収益		
受取利息	1,704	816
有価証券売買等損益	395,131,428	306,070,777
為替差損益	620,336,536	216,846,120
営業収益合計	225,206,812	89,225,473
営業費用		
支払利息	31,892	46,756
受託者報酬	845,295	1,024,583
委託者報酬	26,756,939	24,248,499
その他費用	123,028	122,887
営業費用合計	27,757,154	25,442,725
営業利益又は営業損失()	197,449,658	63,782,748
経常利益又は経常損失()	197,449,658	63,782,748
中間純利益又は中間純損失()	197,449,658	63,782,748
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	47,575,837	12,952,946
期首剰余金又は期首欠損金()	-	102,500,084
剰余金増加額又は欠損金減少額	75,466,785	145,394,855
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	75,466,785	145,394,855
剰余金減少額又は欠損金増加額	16,645,496	30,666,488
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	16,645,496	30,666,488
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	208,695,110	268,058,253

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年1月14日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当中間計算期間は平成29年1月17日から平成29年7月16日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第 1 期 [平成29年1月16日現在]	第 2 期中間計算期間末 [平成29年7月16日現在]
1 期首元本額	3,024,384,297円	5,894,295,655円
期中追加設定元本額	7,952,609,652円	4,727,424,109円
期中一部解約元本額	5,082,698,294円	1,602,364,563円
2 受益権の総数	5,894,295,655口	9,019,355,201口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0174円 (10,174円)	1.0297円 (10,297円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 1 期中間計算期間（自 平成28年1月29日 至 平成28年7月28日）

1 運用に係る権限を委託するための費用

「世界プレミアム企業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45以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

第 2 期中間計算期間（自 平成29年1月17日 至 平成29年7月16日）

1 運用に係る権限を委託するための費用

「世界プレミアム企業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35以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 1 期 [平成29年1月16日現在]	第 2 期中間計算期間末 [平成29年7月16日現在]
1 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左 同 左 同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同 左

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区 分	種 類	第 1 期 [平成29年1月16日現在]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカドル	2,912,498,963		2,836,181,400	76,317,563
	イギリスポンド	509,182,660		482,743,650	26,439,010
	ユーロ	2,429,535,609		2,405,672,400	23,863,209
	合 計	5,851,217,232		5,724,597,450	126,619,782

区 分	種 類	第 2 期中間計算期間末 [平成29年7月16日現在]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカドル	4,770,783,480		4,865,593,600	94,810,120
	イギリスポンド	345,297,456		356,942,700	11,645,244
	ユーロ	2,911,216,365		3,015,020,000	103,803,635
	合 計	8,027,297,301		8,237,556,300	210,258,999

(注) 時価の算定方法

- 1 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。
 当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 (イ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 (ロ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

<参考>

当ファンドは親投資信託受益証券を主要投資対象としております。
 中間貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券の状況は以下の通りです。

「世界プレミア企業債券マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

	[平成29年1月16日現在]	[平成29年7月14日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	101,629,534	8,426,758
コール・ローン	110,246,551	695,506,163
国債証券	51,155,082	540,942,657
特殊債券		70,583,020
社債券	5,685,744,715	7,646,908,719
未収入金	101,121,687	69,893,155
未収利息	46,144,301	47,465,689
前払費用	7,717,407	18,457,328
流動資産合計	6,103,759,277	9,098,183,489
資産合計	6,103,759,277	9,098,183,489
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,126	
未払金	222,524,539	70,583,020
未払解約金	30,000,000	
未払利息	159	1,005
流動負債合計	252,528,824	70,584,025
負債合計	252,528,824	70,584,025
純資産の部		
元本等		
元本	6,098,417,060	9,027,501,946
剰余金		
剰余金又は欠損金()	247,186,607	97,518
元本等合計	5,851,230,453	9,027,599,464
純資産合計	5,851,230,453	9,027,599,464
負債純資産合計	6,103,759,277	9,098,183,489

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年1月15日から7月14日まで、および7月15日から翌年1月14日までであります。

(注2) 平成29年7月16日が休業日のため、前営業日の平成29年7月14日現在における親投資信託の状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[平成29年1月16日現在]	[平成29年7月14日現在]
1 期首	平成28年1月29日	平成29年1月17日
期首元本額	2,960,000,000円	6,098,417,060円
期首からの追加設定元本額	6,116,416,199円	3,287,170,903円
期首からの一部解約元本額	2,977,999,139円	358,086,017円
元本の内訳*		
世界プレミア企業債券ファンド(為替ヘッジあり)	6,098,417,060円	9,027,501,946円
(合計)	6,098,417,060円	9,027,501,946円
2 元本の欠損		
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	247,186,607円	
3 受益権の総数	6,098,417,060口	9,027,501,946口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9595円 (9,595円)	1.0000円 (10,000円)

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成29年1月16日現在]	[平成29年7月14日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>同 左</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありませぬ。</p> <p>同 左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありませぬ。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区 分	種 類	[平成29年1月16日現在]		
		契 約 額 等 (円)	時 価	評 価 損 益
		うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカドル	1,847,002	1,842,876	4,126
	合 計	1,847,002	1,842,876	4,126

[平成29年7月14日現在]

該当事項はありませぬ。

（注）時価の算定方法

- 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。
 当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 （イ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 （ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありませぬ。

【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成29年7月31日現在

(単位:円)

資産総額	10,206,829,198
負債総額	133,447,411
純資産総額(-)	10,073,381,787
発行済口数	9,736,408,654 口
1口当たり純資産価額(/)	1.0346 (1万口当たり 10,346)

<参考>

「世界プレミアム企業債券マザーファンド」の現況

純資産額計算書

平成29年7月31日現在

(単位:円)

資産総額	10,049,839,979
負債総額	129,193,651
純資産総額(-)	9,920,646,328
発行済口数	10,013,454,040 口
1口当たり純資産価額(/)	0.9907 (1万口当たり 9,907)

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

半期代替書面における「委託会社等の概況」の記載のとおりです。

半期代替書面については、(<http://www.am.mufg.jp/corp/profile/accounting.html>)でもご覧いただけます。

(2)【事業の内容及び営業の状況】

半期代替書面における「事業の内容及び営業の概況」の記載のとおりです。

(3)【その他】

該当事項はありません。

5【委託会社等の経理状況】

半期代替書面における「委託会社等の経理状況」の「冒頭書面」の記載のとおりです。

(1)【貸借対照表】

半期代替書面における「委託会社等の経理状況」の(1)「貸借対照表」の記載のとおりです。

(2)【損益計算書】

半期代替書面における「委託会社等の経理状況」の(2)「損益計算書」の記載のとおりです。

(3)【株主資本等変動計算書】

半期代替書面における「委託会社等の経理状況」の(3)「株主資本等変動計算書」の記載のとおりです。

6【その他】

平成29年4月14日提出済みの有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項の一部について、内容の更新等を行います。原届出書の更新後の内容を記載する場合は＜更新後＞とします。

有価証券報告書

第一部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

1 ファンドの性格

(1) ファンドの目的及び基本的性格

[ファンドの目的・特色]

＜更新後＞

（略）

ファンドの特色

（略）



安定的な運用を行うため、主要投資対象を日本を含む先進国の投資適格債券とし、残存年数等に配慮した運用を行うとともに、為替ヘッジを行います。

ポイント 1

日本を含む先進国の投資適格債券に投資します。

（略）

● 投資適格債券に投資

組入債券等は、原則として取得時においてBBB-格相当以上の格付けを有しているものに限りま

- S&Pグローバル・レーティング(S&P)、ムーディーズ・インベスターズ・サービス(Moody's)、フィッチ・レーティングス(Fitch)の3社のうちで最も高い格付けを基準とします。また、これら3格付機関のいずれも格付けを付与していない場合には、FILインベストメンツ・インターナショナルが、同等の信用格付け状況にあるかを判断します。

（略）

ポイント 3

為替ヘッジを行うことにより、為替変動リスクの低減をはかります。

（略）

＜投資リターンのイメージ図＞



・上記は為替ヘッジを理解して頂くためのイメージ図であり、ファンドの将来の運用状況・成果等を示唆・保証するものではありません。



債券等の運用にあたっては、FILインベストメンツ・インターナショナルに運用指図に関する権限を委託します。

（略）



（略）

（3）ファンドの仕組み

委託会社の概況

<更新後>

- ・資本金
2,000百万円（平成29年7月末現在）
（略）
- ・大株主の状況（平成29年7月末現在）
（略）

4 手数料等及び税金

（5）課税上の取扱い

<更新後>

- （略）
- 上記は平成29年7月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- （略）

第二部 委託会社等の情報

第2 その他の関係法人の概況

1 名称、資本金の額及び事業の内容

（1）受託会社

<更新後>

- （略）
- 資本金の額：324,279百万円（平成29年3月末現在）
- （略）

（2）販売会社

<更新後>

名称	資本金の額 (平成29年3月末現在)	事業の内容
株式会社三菱東京UFJ銀行	1,711,958 百万円	銀行業務を営んでいます。
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(3) 再委託先

(略)

資本金の額：225,000ポンド(平成29年7月末現在)

(略)

3 資本関係

<更新後>

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。(平成29年7月末現在)

(略)

独立監査人の中間監査報告書

平成29年8月23日

三菱UFJ国際投信株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 柴 毅 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界プレミア企業債券ファンド（為替ヘッジあり）の平成29年1月17日から平成29年7月16日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、世界プレミア企業債券ファンド（為替ヘッジあり）の平成29年7月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年1月17日から平成29年7月16日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

三菱UFJ国際投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは中間監査の対象に含まれていません。