

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書
【提出先】 関東財務局長
【提出日】 平成28年11月9日
【計算期間】 第16期（自 平成27年8月11日 至 平成28年8月10日）
【ファンド名】 三菱UFJ 外国債券オープン
【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

【提出書類】 募集事項等記載書面
【提出先】 関東財務局長
【提出日】 平成28年11月9日
【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
【届出の対象とした募集内国投資信託受
益証券に係るファンドの名称】 三菱UFJ 外国債券オープン
【届出の対象とした募集内国投資信託受
益証券の金額】 継続募集額 上限1兆円
【縦覧に供する場所】 該当ありません

（注）金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第5条第12項の規定により、募集事項等記載書面を有価証券報告書と併せて提出することにより、有価証券届出書を提出したものとみなされます。

【証券情報】**（１）【ファンドの名称】**

三菱UFJ 外国債券オープン（「ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託です。

当初元本は1口当たり1円です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

（略称：外国債券）

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：毎営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <http://www.am.mufg.jp/>

（注）基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。

なお、当ファンドでは1万口当たりの価額で表示されます。

毎営業日とは、土曜日、日曜日、「国民の祝日に関する法律」に定める休日ならびに12月31日、1月2日および1月3日以外の日とします。以下、同じ。

（５）【申込手数料】

申込価額（発行価格）×1.08%（税抜1%）を上限として販売会社が定める手数料率

申込手数料は販売会社にご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：毎営業日の9:00～17:00）

申込みには分配金受取りコース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があり、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

消費税および地方消費税に相当する金額（「消費税等相当額」といいます。）を含みます。なお、消費税率に応じて変更となることがあります。

（６）【申込単位】

申込単位は販売会社にご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：毎営業日の9:00～17:00）

分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については1口単位とします。

（ 7 ） 【 申込期間 】

平成28年11月10日から平成29年11月 9 日までです。

（注）上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

（ 8 ） 【 申込取扱場所 】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認ください。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：毎営業日の9:00～17:00）

（ 9 ） 【 払込期日 】

取得申込者は、申込金額および申込手数料（税込）を販売会社が定める日までに支払うものとします。

払込期日は販売会社により異なる場合がありますので、販売会社にご確認ください。

振替受益権に係る各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

（ 10 ） 【 払込取扱場所 】

申込みを受け付けた販売会社とします。

（ 11 ） 【 振替機関に関する事項 】

ファンドの受益権の振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、振替機関の振替業に係る業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。ファンドの分配金、償還金、解約代金は、社振法および振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

（ 12 ） 【 その他 】

該当事項はありません。

【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】

当ファンドは、三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、ベンチマーク（シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース））に連動する投資成果を目指して運用を行います。

信託金の限度額は、3,000億円です。

当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
		債券		
追加型	海外	不動産投信	MRF	特殊型 ()
	内外	その他資産 () 資産複合	ETF	

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回 年6回	グローバル (日本を除く)	ファミリー ファンド	あり ()	日経225 TOPIX	ブル・ベア型 条件付運用型
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ()	(隔月) 年12回 (毎月) 日々 その他 ()	日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	その他 (シティ世界 国債インデッ クス(除く日 本、円ベー ス))	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型 その他 ()
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (債券 一般 ク レジット属性(高 格付債)) 資産複合 ()						

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載していません。

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。
	MRF（マネー・リザーブ・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMRFをいいます。
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	特殊型	信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

属性区分の定義

投資対象 資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（BBB格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（BB格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。	
	その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。	
資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。		
決算頻度	年1回	信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年2回	信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年4回	信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年6回（隔月）	信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年12回（毎月）	信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。	
	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。	
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。	

投資対象地域	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東(中東)	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産(一部組み入れている場合等を除きます。)を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。)を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経225	信託約款において、日経225に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	TOPIX	信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動(一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。)を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型/絶対収益追求型	信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

日本を除く世界各国の公社債を実質的な主要投資対象とし、日本を除く世界各国の国債の指標であるシティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動する投資成果をめざします。

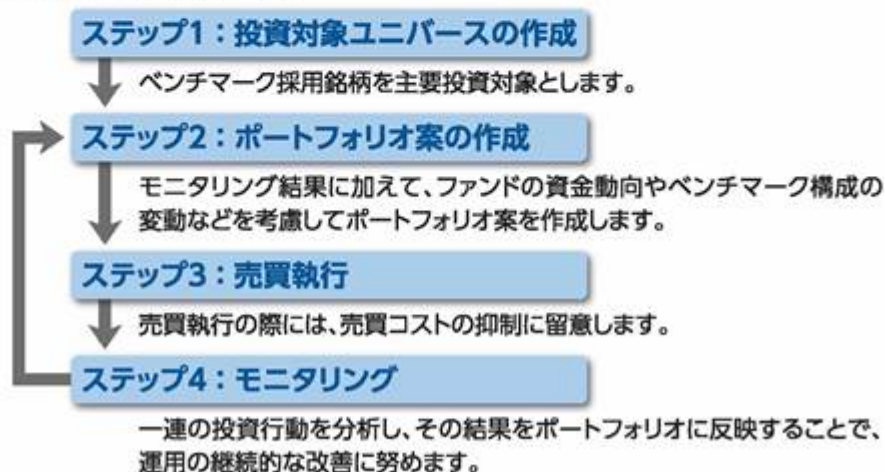
ファンドの特色



日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

- 運用にあたっては、三菱UFJ 外国債券マザーファンドを主要投資対象とします。なお、公社債、短期金融商品に直接投資することもできます。株式への投資は、転換社債および転換社債型新株予約権付社債の転換等により取得したものに限りします。

<運用プロセスのイメージ>



- !** 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。
- 📄** 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ(<http://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)でご覧いただけます。

特色2

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。

- シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとします。
- ファンドが連動をめざすシティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は日本を除く世界主要国の国債(投資適格債)のみを対象としており、したがってファンドは日本を除く世界各国の公社債の中から投資適格債を実質的な主要投資対象として運用を行います。

📌 シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)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。当該指数は、以下の22カ国で構成されています(2016年8月末現在)。ただし、構成国は変わる可能性があります。



<長期信用格付けについて>

	信用力									
	高い					低い				
	投資適格格付け					投機的格付け				
Moody's	Aaa	Aa	A	Baa	Ba	B	Caa	Ca	C	-
S&P	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC	CC	C	D

ムーディーズ・インベスターズ・サービス(Moody's)のAaからCaaまでの格付けには「1,2,3」、スタンダード・アンド・プアーズ(S&P)のAAからCCCまでの格付けには「+,-」という付加記号を省略して表示しています。

- 📌 長期信用格付けとは、債券の中長期的な元本・利子の支払いの確実性の度合いについてランク付けしたものです。これは、アルファベットを使った簡単な記号で表現されており、世界各国、産業別の債券について比較しやすいため、広く利用されています。

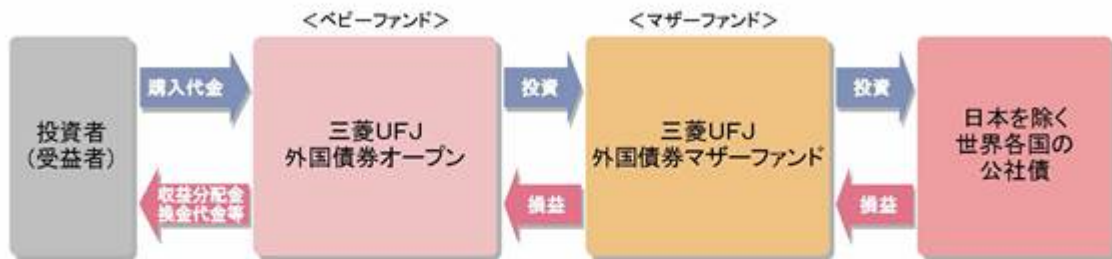
特色3

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。

- 為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。ただし、市況動向の判断により、為替ヘッジを行う場合があります。
- 📌 市況動向とは、天災地変・テロ・戦争等による市場の急変時等を想定しています。

■ファンドの仕組み

運用は主に三菱UFJ 外国債券マザーファンドへの投資を通じて、日本を除く世界各国の公社債へ実質的に投資するファミリーファンド方式により行います。



■主な投資制限

外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
デリバティブ	デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。

■分配方針

- 年1回の決算時(8月10日(休業日の場合は翌営業日))に分配を行います。
- 分配金額は委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案して決定します。
- 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、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

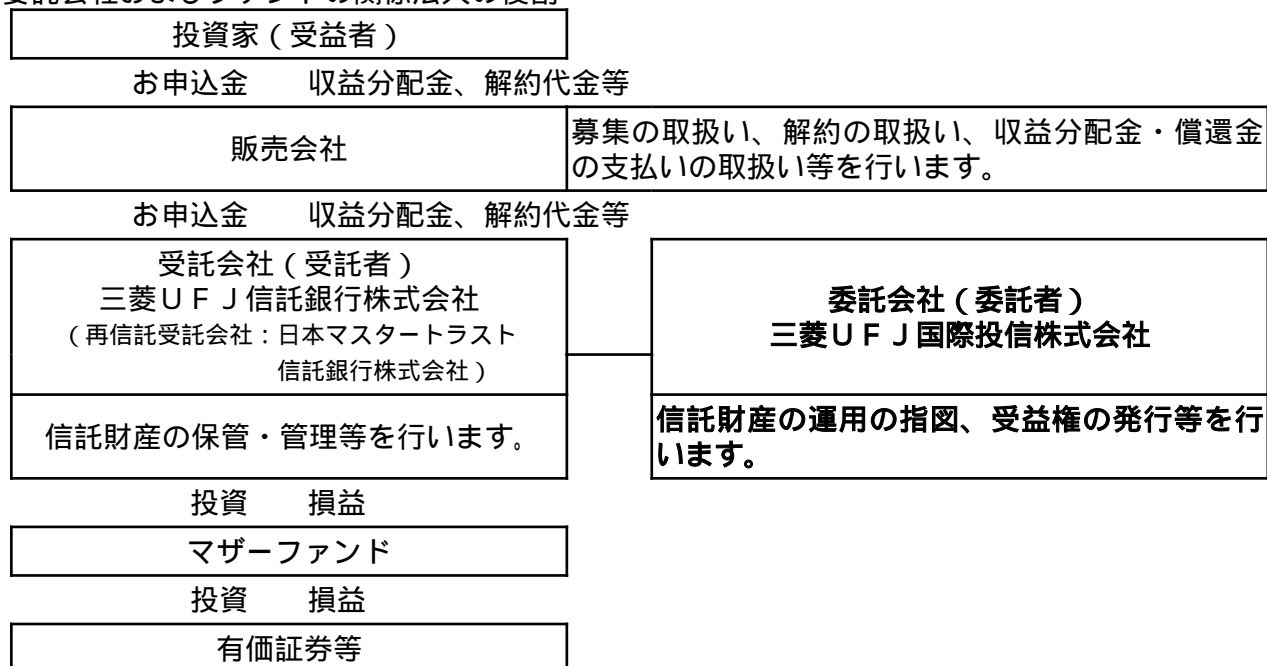
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

平成12年8月18日	設定日、信託契約締結、運用開始
平成16年10月1日	ファンドの名称を「東京三菱 外国債券オープン」から「三菱 外国債券オープン」に変更
平成17年10月1日	ファンドの名称を「三菱 外国債券オープン」から「三菱UFJ」外国債券オープン」に変更

(3) 【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割



委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「募集・販売の取扱い等に関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。

委託会社の概況

- ・資本金
2,000百万円（平成28年8月末現在）
- ・沿革
 - 平成9年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
 - 平成16年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
 - 平成17年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更
 - 平成27年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更
- ・大株主の状況（平成28年8月末現在）

株主名	住所	所有株式数	所有比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	107,855株	51.0%
三菱UFJ証券ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内二丁目5番2号	71,969株	34.0%
株式会社三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	31,757株	15.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、ベンチマーク（シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース））に連動する投資成果を目指して運用を行います。

また、公社債、短期金融商品に直接投資することもできます。

株式への投資は、転換社債および転換社債型新株予約権付社債の転換等により取得したものに限り
ます。

なお、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

また、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引ならびに金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款に定める次のものに限りま

す。）

a. 有価証券先物取引等

b. スワップ取引

c. 金利先渡取引および為替先渡取引

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、三菱UFJ国際投信株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社として締結された三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）のほか、次に掲げるものとします。

1. 転換社債の転換、新株引受権付社債ならびに新株引受権証券の新株引受権行使および新株予約権の行使により取得した株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6. 資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9. 資産の流動化に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10. コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から11. の証券または証書の性質を有するもの
 13. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券
 14. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
 15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 20. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
 21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 22. 外国の者に対する権利で21. の有価証券の性質を有するもの
- なお、1. の証券または証書ならびに12. および17. の証券または証書のうち1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から6. までの証券ならびに12. および17. の証券または証書のうち2. から6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13. および14. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

この信託において投資の対象とする金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)は、次に掲げるものとします。

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5. の権利の性質を有するもの

その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・外国為替予約取引

<三菱UFJ 外国債券マザーファンドの概要>

(基本方針)

この投資信託は、日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマーク(シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース))に連動する投資成果を目指して運用を行います。

(運用方法)

投資対象

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマーク(シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース))に連動する投資成果を目指して運用を行います。

また、外貨建資産については原則としてヘッジを行いません。ただし、市況動向等の判断により、為替ヘッジを行う場合があります。

株式への投資は、転換社債および転換社債型新株予約権付社債の転換等により取得したものに限り、

なお、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券

オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

また、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引ならびに金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(投資制限)

株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

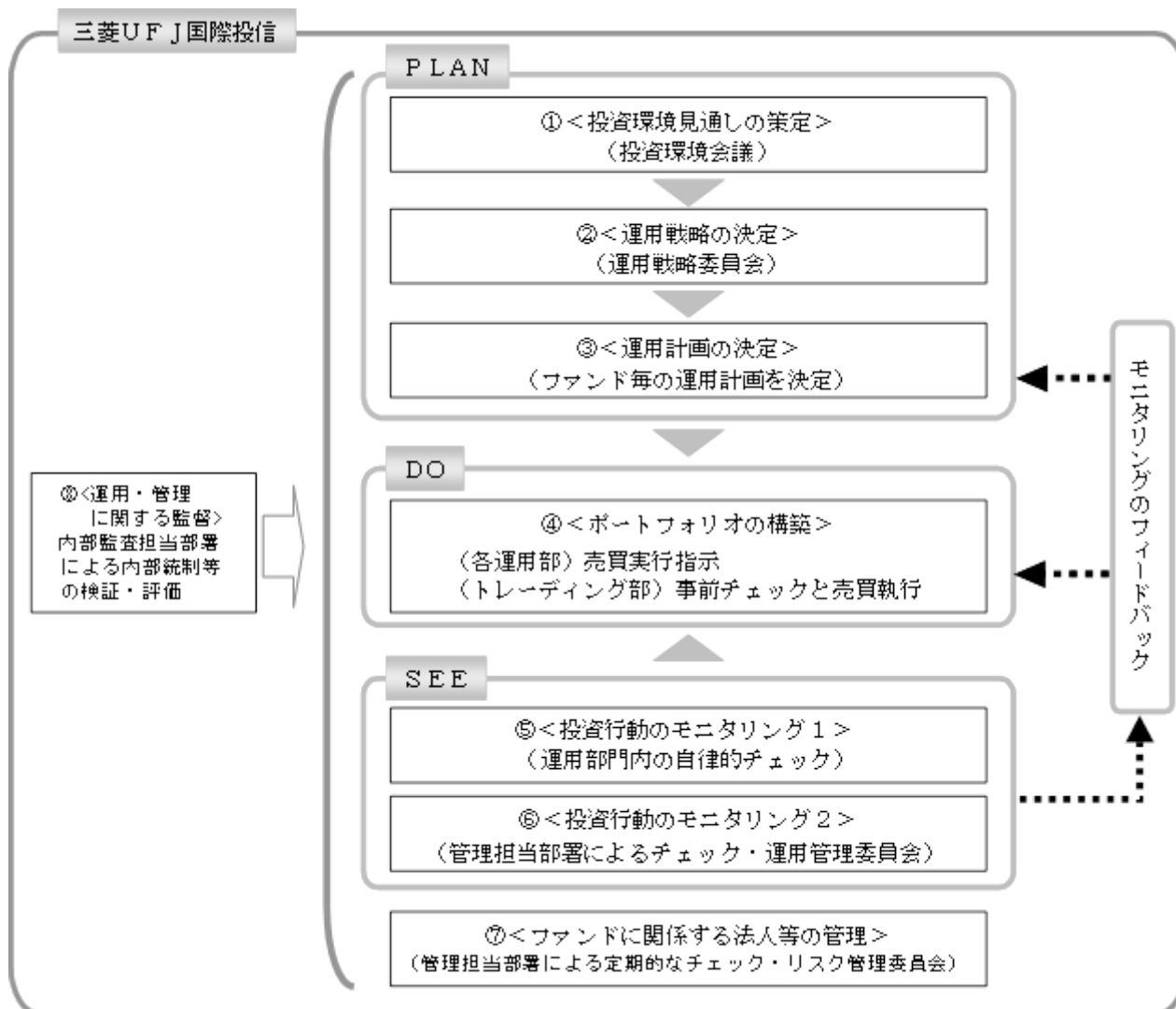
同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

(3) 【運用体制】

**投資環境見通しの策定**

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部門から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

投資行動のモニタリング 1

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

投資行動のモニタリング 2

運用部門から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に係る法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署(10名程度)は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

さらに、委託会社は、三菱UFJ信託銀行からの投資環境および全資産に関する助言を活用して、質の高い運用サービスの提供に努めています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

(4)【分配方針】

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

分配対象収益等の範囲

経費控除後の利子・配当収入および売買益等の全額とします。

分配対象収益等についての分配方針

分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益等が少額の場合には分配を行わないこともあります。

留保益等の運用方針

収益分配に充てず信託財産内に留保した収益等については、信託約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行います。

(5)【投資制限】

< 信託約款に定められた投資制限 >

株式

a. 委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額と親投資信託の信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

b. a.、
において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する親投資信託の受益証券の時価総額に親投資信託の信託財産の純資産総額に占める当該有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

新株引受権証券および新株予約権証券

委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と親投資信託の信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

投資信託証券

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額と親投資信託の信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

同一銘柄の株式等

a. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額と親投資信託の信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

b. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と親投資信託の信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

同一銘柄の転換社債等

a. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債(新株予約権付社債のうち、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。)の時価総額と親投資信託の信託財産に属する当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する親投資信託の受益証券の時価総額に親投資信託の信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

スワップ取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとし、
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとし、

信用取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとし、
- b. a. の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとし、

外国為替予約取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- b. a. の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとし、ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- c. b. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとし、

公社債の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとし、
- b. a. の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとし、

資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに運用の安定性をはかるため、信託財産において一部解約金の支払資金に不足額が生じるときは、資金借入れの指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとし、
- b. a. の資金借入額は、次に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
1. 一部解約金の支払資金の手当のために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内。
 2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内。
 3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内。
- c. b. の借入期間は、有価証券等の売却代金の入金日までに限るものとし、

投資する株式等の範囲

- a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずるものとして別に定める市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- b. a. の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- b. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

有価証券の貸付

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. a. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

公社債の空売り

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債(信託財産により借入れた公社債を含みます。)の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- b. a. の売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

デリバティブ取引等

デリバティブ取引等(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。)については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。

信用リスクの分散規制

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

<その他法令等に定められた投資制限>

- ・同一の法人の発行する株式への投資制限

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

当ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けますが、これらの運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。このため、お申込みの際は、当ファンドのリスクを認識・検討し、慎重に投資のご判断を行っていただく必要があります。

価格変動リスク

一般に、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動するため、当ファンドはその影響を受け公社債の価格が下落した場合には基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

為替変動リスク

実質的な主要投資対象である海外の公社債は外貨建資産であり、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。そのため、為替相場が円高方向に進んだ場合には、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信用リスク

信用リスクとは、有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等に、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払いや償還金の支払いが滞る等の債務が不履行となること等をいいます。当ファンドは、信用リスクを伴い、その影響を受けますので、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

流動性リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない、または取引が不可能となるリスクのことを流動性リスクといい、当ファンドはそのリスクを伴います。例えば、組み入れている公社債の売却を十分な流動性の下で行えないときは、市場実勢から期待される価格で売却できない可能性があります。この場合、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

留意事項

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- 収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- 当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- 当ファンドは、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動することをめざして運用を行います。信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、債券先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比の違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因により乖離を生じることがあります。

（２）投資リスクに対する管理体制

「投資リスク」をファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うこと、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行うこと、を基本の考え方として、投資リスクの管理体制を構築しています。

また、定期的開催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。

各投資リスクに関する管理体制は以下の通りです。

価格変動リスク・為替変動リスク

価格変動リスク・為替変動リスクは、運用部門において、資産構成比率に関する事項や、その他のファンドのリスク特性に関する事項を主な対象項目として常時把握し、ファンドコンセプトに沿ったリスクの範囲でコントロールしています。

また、価格変動リスク・為替変動リスクは、運用部門から独立した管理担当部署によってリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行う体制をとっており、この結果は運用管理委員会等に報告されます。

信用リスク

信用リスクについては、運用部門においてリスクの把握、ファンド毎に定められたリスクの範囲での運用、を行っているほか、運用部門から独立した管理担当部署でモニタリングを行うなど、価格変動リスク・為替変動リスクと同様の管理体制をとっています。

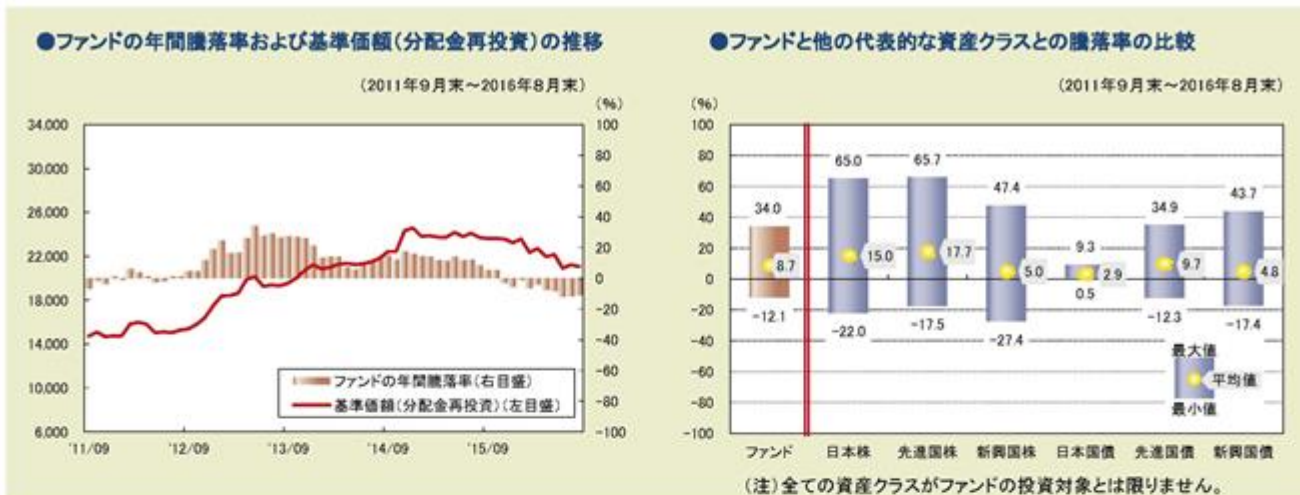
信用リスクは、財務・格付基準に関する事項や、分散投資に関する事項などを主な対象項目として管理していますが、格付等の外形的基準にとどまらず、発行体情報の収集と詳細な分析を行うよう努めています。

流動性リスク

流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立した管理担当部署においても流動性についての情報収集や分析・管理を行い、この結果は運用管理委員会等に報告されます。

■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のとして計算しており、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)の高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ロクサイ・インデックス(配当込み)	MSCIロクサイ・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ロクサイ・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、野村證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)は野村證券株式会社の知的財産であり、運用成果等に関し、野村證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・ダイバースファイド	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバースファイドとは、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。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込価額（発行価格）×1.08%（税抜1%）を上限として販売会社が定める手数料率

申込手数料は販売会社にご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：毎営業日の9:00～17:00）

申込みには分配金受取りコース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があり、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

消費税および地方消費税に相当する金額（「消費税等相当額」といいます。）を含みます。なお、消費税率に応じて変更となることがあります。

(2)【換金（解約）手数料】

解約手数料はかかりません。

ただし、解約時に信託財産留保額（当該基準価額の0.3%）が差し引かれます。

換金の詳細については販売会社にご確認ください。

(3)【信託報酬等】

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、以下により計算されます。

信託財産の純資産総額 × 年1.08%（税抜年1%）

1万口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額 × 信託報酬率 ×（保有日数 / 365）

上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

委託会社は、信託報酬から、販売会社に対し、販売会社の行う業務に対する報酬を支払います。したがって、実質的な信託報酬の配分は、次の通りとなります。

委託会社	販売会社	受託会社
年0.513% （税抜年0.475%）	年0.513% （税抜年0.475%）	年0.054% （税抜年0.05%）

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。

消費税等相当額を含みます。なお、消費税率に応じて変更となることがあります。

(4)【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立て替えた立替金の利息、借入金の利息および借入れに係る品借料は、受益者の負担として信託財産から支払われます。

上記の信託事務の処理に要する諸費用には、有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等、外国での資産の保管等に要する費用等が含まれます。

(*)「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。

ご投資家のみなさまにご負担いただく手数料等の合計額については、お申込金額や保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。なお、当ファンドが負担する費用（手数料等）の支払い実績は、交付運用報告書に開示されていますのでご参照ください。

費用または費用を対価とする役務の内容について

費用名	直接・間接	説明
申込手数料	直接	商品および投資環境の説明・情報提供、購入に関する事務手続等の対価
換金（解約）手数料	直接	商品の換金に関する事務手続等の対価
信託財産留保額	直接	信託期間の途中で換金する場合に、換金に必要な費用を賄うため換金代金から控除され、信託財産中に留保される額
信託報酬	間接	（委託会社（再委託先への報酬を含む場合があります。）） 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） 分配金・償還金・換金代金支払等の事務手続き、交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の説明・情報提供等の対価 （受託会社） 投資信託財産の保管・管理、運用指図の実行等の対価
監査報酬	間接	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
売買委託手数料	間接	有価証券等を売買する際に発生する費用
保管費用 （カストディフィー）	間接	外国での資産の保管等に要する費用

上記は一般的な用語について説明したものです。

受益者が直接的に負担する費用か、間接的に負担する費用かの区別です。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の譲渡益については、次の通り課税されます。

１．収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されません。原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません。）・申告分離課税を選択することもできます。

２．解約時および償還時の課税

解約価額および償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得とみなされて課税されます。

20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

解約時および償還時の損失（譲渡損）については、確定申告により収益分配金を含む上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）との損益通算が可能となる仕組みがあります。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算は

できません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

個別元本について

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にそ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、その後の当該受益者の個別元本となります。

収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にそ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、その後の当該受益者の個別元本となります。

上記は平成28年8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。

課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成28年8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	4,041,706,934	99.99
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		281,815	0.01
純資産総額		4,041,988,749	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。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

平成28年8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(%)	投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	償還期限 (年/月/日)	
日本	三菱UFJ 外国債券マザー ファンド	親投資信託 受益証券		1,636,119,878	2.4341 2.4703	3,982,479,396 4,041,706,934		99.99

(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28年8月31日現在

種類/業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

(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。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成28年8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7計算期間末日 (平成19年 8月10日)	7,786,374,842 (分配付) 7,491,308,004 (分配落)	14,493 (分配付) 13,944 (分配落)
第8計算期間末日 (平成20年 8月11日)	8,979,538,188 (分配付) 8,667,431,095 (分配落)	14,364 (分配付) 13,865 (分配落)
第9計算期間末日 (平成21年 8月10日)	7,793,142,341 (分配付) 7,574,695,009 (分配落)	12,465 (分配付) 12,115 (分配落)
第10計算期間末日 (平成22年 8月10日)	7,167,708,113 (分配付) 6,971,420,233 (分配落)	10,955 (分配付) 10,655 (分配落)
第11計算期間末日 (平成23年 8月10日)	6,454,702,965 (分配付) 6,296,418,546 (分配落)	10,195 (分配付) 9,945 (分配落)
第12計算期間末日 (平成24年 8月10日)	5,498,373,784 (分配付) 5,387,788,832 (分配落)	9,944 (分配付) 9,744 (分配落)
第13計算期間末日 (平成25年 8月12日)	5,259,063,936 (分配付) 5,173,856,138 (分配落)	12,344 (分配付) 12,144 (分配落)
第14計算期間末日 (平成26年 8月11日)	4,549,746,849 (分配付) 4,482,924,644 (分配落)	13,617 (分配付) 13,417 (分配落)
第15計算期間末日 (平成27年 8月10日)	4,659,572,635 (分配付) 4,598,045,550 (分配落)	15,146 (分配付) 14,946 (分配落)

第16計算期間末日 （平成28年 8月10日）	3,973,969,152（分配付） 3,927,457,533（分配落）	12,816（分配付） 12,666（分配落）
平成27年 8月末日	4,553,107,211	14,627
9月末日	4,527,266,024	14,577
10月末日	4,538,804,733	14,575
11月末日	4,482,820,486	14,552
12月末日	4,385,875,614	14,338
平成28年 1月末日	4,466,099,200	14,546
2月末日	4,227,822,044	13,791
3月末日	4,323,381,369	14,026
4月末日	4,188,563,158	13,562
5月末日	4,228,753,084	13,672
6月末日	3,991,936,896	12,908
7月末日	4,072,043,246	13,106
8月末日	4,041,988,749	12,846

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第7計算期間	550円
第8計算期間	500円
第9計算期間	350円
第10計算期間	300円
第11計算期間	250円
第12計算期間	200円
第13計算期間	200円
第14計算期間	200円
第15計算期間	200円
第16計算期間	150円

【収益率の推移】

	収益率（％）
第7計算期間	8.20
第8計算期間	3.01
第9計算期間	10.09
第10計算期間	9.57
第11計算期間	4.31
第12計算期間	0.01
第13計算期間	26.68
第14計算期間	12.12
第15計算期間	12.88
第16計算期間	14.25

（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。

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第7計算期間	1,420,046,277	1,239,023,884	5,372,508,027
第8計算期間	1,776,039,939	897,222,305	6,251,325,661
第9計算期間	1,154,983,101	1,154,217,142	6,252,091,620
第10計算期間	1,214,940,449	924,102,717	6,542,929,352
第11計算期間	1,138,638,681	1,350,191,264	6,331,376,769
第12計算期間	828,363,712	1,630,492,858	5,529,247,623
第13計算期間	945,137,892	2,213,995,598	4,260,389,917
第14計算期間	513,946,274	1,433,225,933	3,341,110,258
第15計算期間	462,614,217	727,370,178	3,076,354,297
第16計算期間	405,636,981	381,216,664	3,100,774,614

< 参考 >

「三菱UFJ」外国債券マザーファンド」

(1) 投資状況

平成28年8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	27,617,449,108	42.28
	フランス	6,482,549,280	9.92
	イタリア	6,314,944,065	9.67
	イギリス	5,286,734,237	8.09
	ドイツ	4,794,738,534	7.34
	スペイン	3,553,183,815	5.44
	ベルギー	1,678,387,306	2.57
	オランダ	1,528,018,280	2.34
	カナダ	1,325,150,608	2.03
	オーストラリア	1,211,371,228	1.85
	オーストリア	1,012,304,990	1.55
	メキシコ	557,390,566	0.85
	アイルランド	518,194,312	0.79
	デンマーク	444,530,029	0.68
	フィンランド	404,374,213	0.62
	ポーランド	369,537,347	0.57
	スウェーデン	320,892,322	0.49
	マレーシア	305,593,760	0.47
	南アフリカ	297,331,099	0.46
	シンガポール	239,457,244	0.37
ノルウェー	161,604,370	0.25	
スイス	143,646,888	0.22	
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		749,729,742	1.15
純資産総額		65,317,113,343	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。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成28年8月31日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	券面総額	上段：帳簿価額		利率(%)	投資 比率 (%)	
					下段：評価額				
					単価(円)	金額(円)	償還期限 (年/月/日)		
アメリカ	0.875 T-NOTE 180531	国債証券		4,300,000.00	10,318.00	443,674,000	0.875000	0.68	
アメリカ	2.25 T-NOTE 251115	国債証券		3,500,000.00	10,675.09	373,628,483	2.250000	0.59	
アメリカ	2 T-NOTE 230215	国債証券		3,450,000.00	10,922.5703	382,289,960	2025/11/15		
アメリカ	2 T-NOTE 250815	国債証券		3,300,000.00	10,563.68	364,447,171	2.000000	0.57	
アメリカ	2 T-NOTE 250815	国債証券		3,300,000.00	10,710.5676	369,514,583	2023/02/15		
アメリカ	2 T-NOTE 250815	国債証券		3,300,000.00	10,461.42	345,226,866	2.000000	0.54	
アメリカ	2 T-NOTE 250815	国債証券		3,300,000.00	10,698.4762	353,049,716	2025/08/15		
フランス	4.5 O.A.T 410425	国債証券		1,550,000.00	19,233.55	298,120,066	4.500000	0.50	
フランス	4.5 O.A.T 410425	国債証券		1,550,000.00	20,872.7359	323,527,407	2041/04/25		
アメリカ	1.375 T-NOTE 201031	国債証券		3,100,000.00	10,338.15	320,482,721	1.375000	0.49	
アメリカ	1.375 T-NOTE 201031	国債証券		3,100,000.00	10,419.5678	323,006,601	2020/10/31		
アメリカ	1.625 T-NOTE 190831	国債証券		3,000,000.00	10,492.37	314,771,226	1.625000	0.48	
アメリカ	1.625 T-NOTE 190831	国債証券		3,000,000.00	10,527.5843	315,827,531	2019/08/31		
アメリカ	2.875 T-BOND 430515	国債証券		2,600,000.00	10,868.98	282,593,511	2.875000	0.47	
アメリカ	2.875 T-BOND 430515	国債証券		2,600,000.00	11,711.7360	304,505,137	2043/05/15		
フランス	3.5 O.A.T 260425	国債証券		1,950,000.00	14,957.18	291,665,083	3.500000	0.46	
フランス	3.5 O.A.T 260425	国債証券		1,950,000.00	15,268.1188	297,728,316	2026/04/25		
アメリカ	0.625 T-NOTE 170831	国債証券		2,800,000.00	10,298.25	288,351,019	0.625000	0.44	
アメリカ	0.625 T-NOTE 170831	国債証券		2,800,000.00	10,315.1786	288,825,002	2017/08/31		
アメリカ	2.5 T-BOND 450215	国債証券		2,650,000.00	10,036.67	265,971,840	2.500000	0.44	
アメリカ	2.5 T-BOND 450215	国債証券		2,650,000.00	10,895.9692	288,743,183	2045/02/15		
イギリス	3.5 GILT 680722	国債証券		1,090,000.00	19,282.16	210,175,549	3.500000	0.44	
イギリス	3.5 GILT 680722	国債証券		1,090,000.00	26,383.0675	287,575,435	2068/07/22		
アメリカ	1.875 T-NOTE 200630	国債証券		2,700,000.00	10,575.95	285,550,650	1.875000	0.44	
アメリカ	1.875 T-NOTE 200630	国債証券		2,700,000.00	10,626.7339	286,921,814	2020/06/30		
アメリカ	1.375 T-NOTE 180930	国債証券		2,700,000.00	10,420.37	281,350,095	1.375000	0.43	
アメリカ	1.375 T-NOTE 180930	国債証券		2,700,000.00	10,435.6896	281,763,621	2018/09/30		

アメリカ	2.125 T-NOTE 250515	国債証券		2,600,000.00	10,578.01 10,806.4928	275,028,353 280,968,813	2.125000 2025/05/15	0.43
アメリカ	2 T-NOTE 250215	国債証券		2,500,000.00	10,479.99 10,700.8945	261,999,815 267,522,362	2.000000 2025/02/15	0.41
アメリカ	3 T-BOND 441115	国債証券		2,200,000.00	11,147.95 12,007.5725	245,254,934 264,166,595	3.000000 2044/11/15	0.40
アメリカ	3.125 T-BOND 440815	国債証券		2,150,000.00	11,383.84 12,286.4809	244,752,762 264,159,339	3.125000 2044/08/15	0.40
アメリカ	3.375 T-BOND 440515	国債証券		2,050,000.00	11,930.70 12,844.2978	244,579,419 263,308,104	3.375000 2044/05/15	0.40
アメリカ	1.125 T-NOTE 210630	国債証券		2,500,000.00	10,375.00 10,288.9806	259,375,096 257,224,515	1.125000 2021/06/30	0.39
アメリカ	2.125 T-NOTE 220630	国債証券		2,300,000.00	10,663.65 10,783.1160	245,264,019 248,011,669	2.125000 2022/06/30	0.38
アメリカ	0.875 T-NOTE 181015	国債証券		2,400,000.00	10,297.44 10,328.8822	247,138,669 247,893,173	0.875000 2018/10/15	0.38
フランス	2.5 O.A.T 201025	国債証券		1,900,000.00	12,901.41 12,933.4843	245,126,851 245,736,201	2.500000 2020/10/25	0.38
アメリカ	6 T-BOND 260215	国債証券		1,700,000.00	14,194.01 14,392.8039	241,298,207 244,677,665	6.000000 2026/02/15	0.37
イタリア	5 ITALY GOVT 340801	国債証券		1,400,000.00	16,235.20 17,454.5827	227,292,934 244,364,158	5.000000 2034/08/01	0.37
フランス	4.25 O.A.T 231025	国債証券		1,600,000.00	15,052.73 15,231.3348	240,843,814 243,701,356	4.250000 2023/10/25	0.37
アメリカ	1.5 T-NOTE 190131	国債証券		2,300,000.00	10,455.03 10,475.1882	240,465,826 240,929,330	1.500000 2019/01/31	0.37
アメリカ	2.625 T-NOTE 200815	国債証券		2,200,000.00	10,883.87 10,925.7946	239,445,311 240,367,483	2.625000 2020/08/15	0.37
アメリカ	3 T-BOND 450515	国債証券		2,000,000.00	11,102.16 12,014.0212	222,043,360 240,280,425	3.000000 2045/05/15	0.37
フランス	3.5 O.A.T 200425	国債証券		1,800,000.00	13,222.12 13,197.8693	237,998,227 237,561,647	3.500000 2020/04/25	0.36

(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28年8月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	98.85
合計	98.85

(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。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

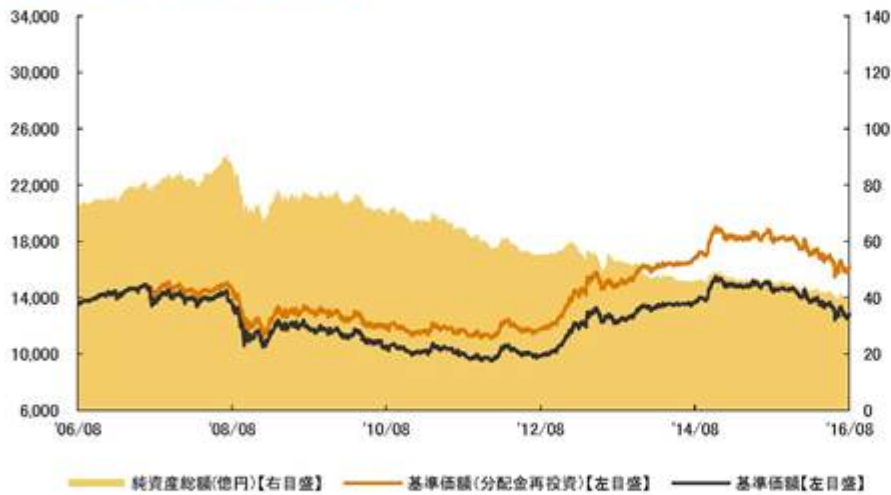
[参考情報]



運用実績

2016年8月31日現在

■基準価額・純資産の推移 2006年8月31日～2016年8月31日



- ・基準価額(分配金再投資)はグラフの起点における基準価額に合わせて指数化
- ・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	12,846円
純資産総額	40.4億円

■分配の推移

2016年 8月	150円
2015年 8月	200円
2014年 8月	200円
2013年 8月	200円
2012年 8月	200円
2011年 8月	250円
設定来累計	6,300円

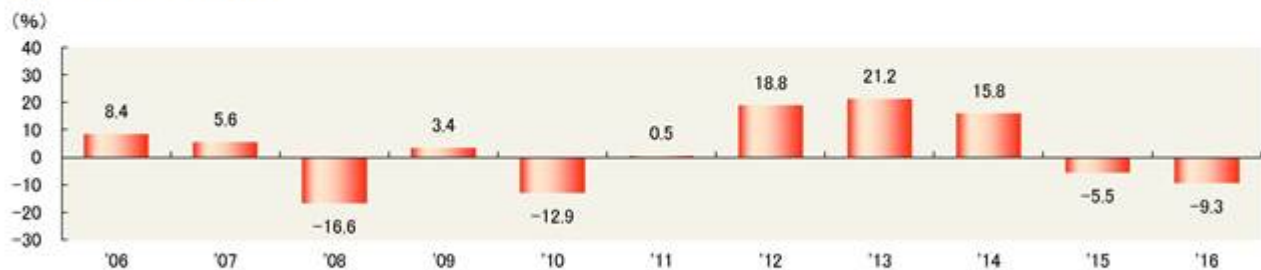
- ・分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

通貨別構成	比率	組入上位銘柄	種別	国・地域	比率
アメリカドル	42.6%	1 0.875 T-NOTE 180531	国債	アメリカ	0.7%
ユーロ	40.8%	2 2.25 T-NOTE 251115	国債	アメリカ	0.6%
イギリスポンド	8.2%	3 2 T-NOTE 230215	国債	アメリカ	0.6%
カナダドル	2.1%	4 2 T-NOTE 250815	国債	アメリカ	0.5%
オーストラリアドル	1.9%	5 4.5 O.A.T 410425	国債	フランス	0.5%
メキシコペソ	0.9%	6 1.375 T-NOTE 201031	国債	アメリカ	0.5%
デンマーククローネ	0.7%	7 1.625 T-NOTE 190831	国債	アメリカ	0.5%
ポーランドズロチ	0.6%	8 2.875 T-BOND 430515	国債	アメリカ	0.5%
その他	2.2%	9 3.5 O.A.T 260425	国債	フランス	0.5%
合計	100.0%	10 0.625 T-NOTE 170831	国債	アメリカ	0.4%

- ・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年は年初から8月31日までの収益率を表示

**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。**

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込みの受付	原則として、いつでも申込みができます。
申込単位	販売会社が定める単位
申込価額	申込受付日の翌営業日の基準価額
申込価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
申込単位・申込価額の照会方法	申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。 また、下記においてもご照会いただけます。 三菱UFJ国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。 ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/
申込手数料	申込価額×1.08%（税抜1%）を上限として販売会社が定める手数料率 分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。 消費税等相当額を含みます。なお、消費税率に応じて変更となることがあります。
申込方法	取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。 取得申込者は、申込金額および申込手数料（税込）を販売会社が定める日までに支払うものとします。 なお、申込みには分配金受取りコース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があり、分配金再投資コース（累積投資コース）を選択する場合には、取得申込者と販売会社との間で別に定める累積投資契約（販売会社によっては別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を使用する場合があります、この場合は当該別の名称に読み替えます。）を締結するものとします。申込みコースの取扱いには販売会社により異なる場合がありますので、販売会社にご確認ください。 取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。
申込受付時間	原則、午後3時までに受け付けた取得申込み（当該申込みの受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを）を当日の申込みとします。当該時刻を過ぎたの申込みは、翌営業日に受け付けたものとして取り扱います。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に取得申込みを締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。
その他	金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止することがあります。

2【換金（解約）手続等】

解約の受付	原則として、いつでも解約の請求ができます。
解約単位	販売会社が定める単位（ただし、1万口を上回らないものとします。） なお、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合等は1口単位
解約価額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額 - 信託財産留保額
信託財産留保額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額×0.3%
解約価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
解約価額の照会方法	解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。 なお、下記においてもご照会いただけます。 三菱UFJ国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/

支払開始日	原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。
解約請求受付時間	原則、午後3時までに受け付けた解約請求(当該解約請求の受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを)を当日の請求とします。当該時刻を過ぎての請求は、翌営業日に受け付けたものとして取り扱います。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に解約請求を締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。
その他	委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとします。 委託会社は、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。 受益者の解約請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

換金の詳細については販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出方法	<p>基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数</p> <p>なお、当ファンドでは1万口当たりの価額で表示されます。</p> <p>(注)「信託財産の純資産総額」とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。</p> <p>(主な評価方法)</p> <p>マザーファンド：計算日における基準価額で評価します。</p> <p>株式：原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場(外国で取引されているものについては、原則として、外国金融商品市場における計算時に知りうる直近の日の最終相場)で評価します。</p> <p>公社債等：原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)、第一種金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額で評価します。</p> <p>外貨建資産：原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円換算します。</p> <p>外国為替予約取引：原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。</p>
基準価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
基準価額の照会方法	<p>基準価額は、販売会社にてご確認ください。</p> <p>また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。</p> <p>なお、下記においてもご照会いただけます。</p> <p>三菱UFJ国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/</p>

(2)【保管】

受益証券の保管	該当事項はありません。
---------	-------------

(3) 【信託期間】

信託期間	平成12年8月18日から無期限 ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。
------	---

(4) 【計算期間】

計算期間	原則として、毎年8月11日から翌年8月10日まで 上記にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日が休業日のとき、各計算期間終了日は、この該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日はファンドの信託期間終了日とします。
------	---

(5) 【その他】

ファンドの償還条件等	委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。(任意償還) ・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合 ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。 委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。
信託約款の変更	委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。委託会社は、信託約款を変更しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。
ファンドの償還等に関する開示方法	委託会社は、ファンドの任意償還または信託約款の変更のうち重大な内容の変更を行おうとする場合、あらかじめその旨およびその内容を公告し、かつ、原則としてこれらの事項を記載した書面を受益者に交付します(ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。)。この公告および書面には、原則として、受益者で異議のあるものは一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。
異議申立ておよび反対者の買取請求権	受益者は、委託会社がファンドの任意償還または信託約款について重大な内容の変更を行おうとする場合、原則として、一定の期間(1ヵ月以上)内に委託会社に対して異議を述べるすることができます。異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。なお、一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、ファンドの償還または信託約款の変更を行いません。その場合、償還しない旨または信託約款を変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、原則として、これらの事項を記載した書面を受益者に交付します(ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。)。
関係法人との契約の更改	委託会社と販売会社との間で締結された「募集・販売の取扱い等に関する契約」の期間は、契約締結日から1ヵ年とし、期間満了3ヵ月前までに相手方に対し、何らの意思表示のないときは、同一の条件で契約を更新するものとし、その後も同様とします。
運用報告書	委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、交付運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更等があった場合は、その内容を交付運用報告書に記載します。
委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い	委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

受託会社の辞任および解任に伴う取扱い	受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。
信託事務処理の再信託	受託会社は、ファンドの信託事務の処理の一部について日本マスタートラスト信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託します。日本マスタートラスト信託銀行株式会社は、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。
公告	委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。 http://www.am.mufg.jp/ なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

4【受益者の権利等】

受益者の権利の主な内容は以下の通りです。

収益分配金に対する請求権	<p>受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。</p> <p>「分配金受取りコース（一般コース）」</p> <ul style="list-style-type: none"> ・収益分配金は、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。 ・収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。 ・受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。 <p>「分配金再投資コース（累積投資コース）」</p> <ul style="list-style-type: none"> ・収益分配金は、課税後、原則として毎計算期間の終了日（決算日）の翌営業日に、累積投資契約に基づいて再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。なお、解約時に当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、受益者に支払います。詳しくは販売会社にご確認ください。
償還金に対する請求権	<p>受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・償還金は、原則として償還日（休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日までに支払いを開始します。 ・償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。 ・受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。
換金（解約）請求権	<p>受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約を請求する権利を有します。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・解約代金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。 <p>（「2 換金（解約）手続等」をご参照ください。）</p>

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2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、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、当期(平成27年8月11日から平成28年8月10日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】
【三菱UFJ 外国債券オープン】
(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第 15 期 [平成27年8月10日現在]	第 16 期 [平成28年8月10日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	28,642,525	24,380,051
親投資信託受益証券	4,597,064,943	3,926,570,021
未収入金	60,980,500	49,711,900
未収利息	46	-
流動資産合計	4,686,688,014	4,000,661,972
資産合計	4,686,688,014	4,000,661,972
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	61,527,085	46,511,619
未払解約金	2,474,824	4,408,553
未払受託者報酬	1,232,030	1,114,214
未払委託者報酬	23,408,525	21,170,018
未払利息	-	35
流動負債合計	88,642,464	73,204,439
負債合計	88,642,464	73,204,439
純資産の部		
元本等		
元本	1,307,354,297	1,310,774,614
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,521,691,253	826,682,919
(分配準備積立金)	730,113,730	664,709,972
元本等合計	4,598,045,550	3,927,457,533
純資産合計	4,598,045,550	3,927,457,533
負債純資産合計	4,686,688,014	4,000,661,972

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 15 期 自 平成26年 8月12日 至 平成27年 8月10日	第 16 期 自 平成27年 8月11日 至 平成28年 8月10日
営業収益		
受取利息	8,756	4,403
有価証券売買等損益	613,522,229	611,049,022
営業収益合計	613,530,985	611,044,619
営業費用		
支払利息	-	2,897
受託者報酬	2,512,765	2,331,977
委託者報酬	47,742,435	44,307,409
その他費用	32,400	10
営業費用合計	50,287,600	46,642,293
営業利益又は営業損失（ ）	563,243,385	657,686,912
経常利益又は経常損失（ ）	563,243,385	657,686,912
当期純利益又は当期純損失（ ）	563,243,385	657,686,912
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	81,228,231	27,291,341
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,141,814,386	1,521,691,253
剰余金増加額又は欠損金減少額	210,557,664	167,981,112
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	210,557,664	167,981,112
剰余金減少額又は欠損金増加額	251,168,866	186,082,256
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	251,168,866	186,082,256
分配金	1 61,527,085	1 46,511,619
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,521,691,253	826,682,919

(3) 【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。
-------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	第 15 期 [平成27年8月10日現在]	第 16 期 [平成28年8月10日現在]
1 期首元本額	3,341,110,258円	3,076,354,297円
期中追加設定元本額	462,614,217円	405,636,981円
期中一部解約元本額	727,370,178円	381,216,664円
2 受益権の総数	3,076,354,297口	3,100,774,614口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4946円 (14,946円)	1.2666円 (12,666円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 15 期 (自 平成26年8月12日 至 平成27年8月10日)

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	111,132,692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	B	370,882,462円
収益調整金額	C	791,577,523円
分配準備積立金額	D	309,625,661円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,583,218,338円
当ファンドの期末残存口数	F	3,076,354,297口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	5,146円
1万口当たり分配金額	H	200円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	61,527,085円

第 16 期 (自 平成27年8月11日 至 平成28年8月10日)

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	64,440,953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	B	
収益調整金額	C	810,074,865円
分配準備積立金額	D	646,780,638円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,521,296,456円
当ファンドの期末残存口数	F	3,100,774,614口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	4,906円
1万口当たり分配金額	H	150円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	46,511,619円

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区 分	第 15 期 (自 平成26年 8月12日 至 平成27年 8月10日)	第 16 期 (自 平成27年 8月11日 至 平成28年 8月10日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 親投資信託受益証券は、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、親投資信託受益証券に係るデリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同 左 同 左 同 左

3 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同 左
------------------	--	-----

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 15 期 [平成27年8月10日現在]	第 16 期 [平成28年8月10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ん。
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、該当事項はありません。 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)

売買目的有価証券

種 類	第 15 期 [平成27年8月10日現在]	第 16 期 [平成28年8月10日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	545,508,773	581,009,130
合計	545,508,773	581,009,130

(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

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	口数	評 価 額	備 考
親投資信託受益証券	三菱UFJ 外国債券マザーファンド	1,613,018,125	3,926,570,021	
	親投資信託受益証券 小計	1,613,018,125	3,926,570,021	
合計		1,613,018,125	3,926,570,021	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

<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。
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。

「三菱UFJ」外国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27年8月10日現在]	[平成28年8月10日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	159,603,965	171,660,926
コール・ローン	242,659,852	87,174,758
国債証券	115,984,166,855	64,360,343,343
派生商品評価勘定	596,567	563,057
未収入金	422,126,380	558,851,435
未収利息	1,024,509,778	519,320,066
前払費用	31,274,027	18,791,081
流動資産合計	117,864,937,424	65,716,704,666
資産合計	117,864,937,424	65,716,704,666
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	52,940	19,904
未払解約金	510,602,413	177,174,932
未払利息		127
流動負債合計	510,655,353	177,194,963
負債合計	510,655,353	177,194,963
純資産の部		
元本等		
元本	41,768,999,351	26,923,291,281
剰余金		
剰余金又は欠損金()	75,585,282,720	38,616,218,422
元本等合計	117,354,282,071	65,539,509,703
純資産合計	117,354,282,071	65,539,509,703
負債純資産合計	117,864,937,424	65,716,704,666

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年5月21日から翌年5月20日までであります。

(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27年8月10日現在]	[平成28年8月10日現在]
1 期首		
期首元本額	平成26年8月12日 67,982,507,818円	平成27年8月11日 41,768,999,351円
期首からの追加設定元本額	2,641,795,502円	2,816,690,479円
期首からの一部解約元本額	28,855,303,969円	17,662,398,549円
元本の内訳*		
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	129,924,226円	147,365,251円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	249,725,019円	269,356,811円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	163,981,078円	163,969,938円
三菱UFJ 外国債券オープン	1,636,199,083円	1,613,018,125円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	887,968,648円	1,143,837,723円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	2,333,690,118円	2,719,265,272円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	1,525,868,116円	1,600,583,180円
三菱UFJ 財産分散ファンド(毎月決算型)	725,625,595円	
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	692,450,614円	651,074,288円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	90,371,876円	86,321,058円
FPバランスファンド(安定型)	76,790,718円	
FPバランスファンド(安定成長型)	102,003,837円	
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	96,363,767円	144,218,353円
三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金)	2,033,669,597円	2,086,324,637円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型)	470,023,753円	467,618,044円

三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)	1,291,182,450円	1,320,107,061円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	27,440,631,176円	13,626,210,034円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)VA(適格機関投資家限定)	156,727円	52,302円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)VA(適格機関投資家限定)	733,123円	376,083円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2(適格機関投資家限定)	84,598,439円	54,695,872円
MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)	1,737,041,391円	828,897,249円
(合計)	41,768,999,351円	26,923,291,281円
2 受益権の総数	41,768,999,351口	26,923,291,281口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.8096円 (28,096円)	2.4343円 (24,343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)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	(自平成26年8月12日 至平成27年8月10日)	(自平成27年8月11日 至平成28年8月10日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 デリバティブ取引については、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
3 金融商品に係るリスク管理体制	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

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成27年8月10日現在]	[平成28年8月10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
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)

売買目的有価証券

種類	[平成27年8月10日現在]	[平成28年8月10日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	59,396,882	1,809,351,115
合計	59,396,882	1,809,351,115

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(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27年8月10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	173,280,640		172,929,900	350,740
	カナダドル	8,544,240		8,514,000	30,240
	オーストラリアドル	6,419,900		6,440,500	20,600
	イギリスポンド	34,803,760		34,682,400	121,360
	シンガポールドル	1,796,040		1,796,000	40
	マレーシアリングギット	3,167,000		3,170,000	3,000
	スウェーデンクローネ	1,855,100		1,840,800	14,300
	ノルウェークローネ	1,507,680		1,504,000	3,680
	デンマーククローネ	2,922,760		2,921,600	1,160
	メキシコペソ	4,209,835		4,229,500	19,665
	ポーランドズロチ	1,625,555		1,627,000	1,445
	南アフリカランド	2,451,875		2,457,500	5,625
	ユーロ	163,572,442		163,500,000	72,442
	合計	406,156,827		405,613,200	543,627

区分	種類	[平成28年8月10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	211,689,645		211,332,500	357,145
	カナダドル	10,099,430		10,093,500	5,930
	オーストラリアドル	10,161,470		10,153,300	8,170
	イギリスポンド	41,139,759		41,097,400	42,359
	スイスフラン	2,079,190		2,073,600	5,590
	シンガポールドル	2,270,970		2,270,700	270
	マレーシアリングギット	3,288,486		3,292,900	4,414
	スウェーデンクローネ	2,507,484		2,507,400	84
	ノルウェークローネ	1,937,320		1,940,800	3,480
	デンマーククローネ	3,502,600		3,500,600	2,000
	メキシコペソ	4,573,278		4,565,000	8,278
	ポーランドズロチ	3,717,595		3,714,700	2,895
	南アフリカランド	3,253,515		3,263,700	10,185
	ユーロ	200,474,811		200,346,300	128,511
	合計	500,695,553		500,152,400	543,153

(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ん。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨		券面総額	評価額	備考
種類	銘柄			
アメリカドル				
国債証券	0.5 T-NOTE 170731	1,900,000.00	1,897,550.78	
	0.625 T-NOTE 170731	500,000.00	499,960.93	

0.625 T-NOTE 170831	2,800,000.00	2,799,343.75
0.625 T-NOTE 170930	1,600,000.00	1,599,312.49
0.625 T-NOTE 171130	1,200,000.00	1,198,640.62
0.625 T-NOTE 180430	700,000.00	699,070.31
0.75 T-NOTE 171031	2,300,000.00	2,302,066.40
0.75 T-NOTE 171231	1,100,000.00	1,100,988.28
0.75 T-NOTE 180228	1,100,000.00	1,100,902.34
0.75 T-NOTE 180331	400,000.00	400,359.37
0.75 T-NOTE 180415	500,000.00	500,371.09
0.75 T-NOTE 190215	800,000.00	799,281.24
0.75 T-NOTE 190715	700,000.00	698,386.71
0.875 T-NOTE 170815	900,000.00	902,179.68
0.875 T-NOTE 171015	2,000,000.00	2,004,765.62
0.875 T-NOTE 171115	400,000.00	400,984.37
0.875 T-NOTE 171130	1,800,000.00	1,804,289.06
0.875 T-NOTE 180115	100,000.00	100,261.71
0.875 T-NOTE 180131	1,200,000.00	1,203,375.00
0.875 T-NOTE 180531	4,300,000.00	4,312,933.59
0.875 T-NOTE 181015	2,400,000.00	2,406,468.74
0.875 T-NOTE 190415	1,100,000.00	1,102,105.46
0.875 T-NOTE 190731	300,000.00	300,328.12
1 T-NOTE 170915	1,000,000.00	1,003,710.92
1 T-NOTE 171215	600,000.00	602,460.92
1 T-NOTE 180315	200,000.00	200,945.31
1 T-NOTE 180815	700,000.00	703,746.09
1 T-NOTE 180915	1,900,000.00	1,910,316.40
1 T-NOTE 190630	700,000.00	703,472.65
1 T-NOTE 190831	700,000.00	702,925.78
1 T-NOTE 190930	700,000.00	702,789.06
1 T-NOTE 191130	900,000.00	902,882.81
1.125 T-NOTE 180615	1,200,000.00	1,208,859.37
1.125 T-NOTE 190531	100,000.00	100,878.90
1.125 T-NOTE 191231	800,000.00	805,593.74
1.125 T-NOTE 200331	900,000.00	906,082.03
1.125 T-NOTE 210228	1,400,000.00	1,403,390.62
1.125 T-NOTE 210630	2,500,000.00	2,501,953.12
1.25 T-NOTE 181031	300,000.00	303,281.25
1.25 T-NOTE 181115	1,700,000.00	1,718,527.34
1.25 T-NOTE 181130	500,000.00	505,566.40
1.25 T-NOTE 181215	1,300,000.00	1,314,675.78
1.25 T-NOTE 190131	1,700,000.00	1,719,523.43
1.25 T-NOTE 190430	800,000.00	809,687.50
1.25 T-NOTE 191031	900,000.00	910,371.09
1.25 T-NOTE 200131	1,500,000.00	1,516,406.25
1.25 T-NOTE 200229	100,000.00	101,078.12
1.25 T-NOTE 210331	1,000,000.00	1,007,265.62
1.375 T-NOTE 180731	1,200,000.00	1,215,375.00
1.375 T-NOTE 180930	2,700,000.00	2,736,070.31
1.375 T-NOTE 181130	800,000.00	811,093.74
1.375 T-NOTE 181231	1,400,000.00	1,420,179.68
1.375 T-NOTE 190228	1,700,000.00	1,725,367.18
1.375 T-NOTE 200131	700,000.00	710,582.03
1.375 T-NOTE 200229	1,500,000.00	1,522,851.56
1.375 T-NOTE 200331	1,700,000.00	1,725,898.43
1.375 T-NOTE 200430	1,600,000.00	1,624,250.00
1.375 T-NOTE 200831	500,000.00	507,187.50
1.375 T-NOTE 200930	2,000,000.00	2,028,281.25
1.375 T-NOTE 201031	3,100,000.00	3,143,351.56
1.375 T-NOTE 210131	1,900,000.00	1,925,085.93
1.375 T-NOTE 230630	2,300,000.00	2,301,437.50
1.5 T-NOTE 180831	1,000,000.00	1,015,625.00
1.5 T-NOTE 181231	1,500,000.00	1,525,898.43
1.5 T-NOTE 190131	2,300,000.00	2,340,429.68
1.5 T-NOTE 190228	1,500,000.00	1,527,070.31
1.5 T-NOTE 190331	700,000.00	713,015.62
1.5 T-NOTE 190531	1,200,000.00	1,222,546.87
1.5 T-NOTE 191031	1,700,000.00	1,732,804.68

1.5 T-NOTE 191130	800,000.00	815,500.00
1.5 T-NOTE 200531	1,700,000.00	1,733,203.12
1.5 T-NOTE 220131	400,000.00	406,406.25
1.5 T-NOTE 230331	1,000,000.00	1,009,765.62
1.625 T-NOTE 190331	1,300,000.00	1,328,132.81
1.625 T-NOTE 190430	1,400,000.00	1,430,734.37
1.625 T-NOTE 190630	1,800,000.00	1,840,640.62
1.625 T-NOTE 190731	1,400,000.00	1,431,937.50
1.625 T-NOTE 190831	3,000,000.00	3,069,257.81
1.625 T-NOTE 191231	1,400,000.00	1,433,140.61
1.625 T-NOTE 200731	100,000.00	102,437.50
1.625 T-NOTE 201130	1,800,000.00	1,844,015.62
1.625 T-NOTE 220815	600,000.00	612,843.75
1.625 T-NOTE 221115	1,900,000.00	1,937,851.56
1.625 T-NOTE 260215	1,100,000.00	1,108,250.00
1.625 T-NOTE 260515	2,000,000.00	2,014,531.24
1.75 T-NOTE 181031	1,100,000.00	1,124,234.37
1.75 T-NOTE 190930	500,000.00	513,554.68
1.75 T-NOTE 201031	1,500,000.00	1,544,062.50
1.75 T-NOTE 220228	300,000.00	308,671.87
1.75 T-NOTE 220331	1,400,000.00	1,440,250.00
1.75 T-NOTE 220430	1,200,000.00	1,234,312.50
1.75 T-NOTE 220515	1,400,000.00	1,439,921.87
1.75 T-NOTE 220930	1,500,000.00	1,541,015.62
1.75 T-NOTE 230131	1,200,000.00	1,231,406.25
1.75 T-NOTE 230515	2,100,000.00	2,154,304.68
1.875 T-NOTE 170831	1,500,000.00	1,519,277.34
1.875 T-NOTE 170930	1,700,000.00	1,723,308.59
1.875 T-NOTE 171031	1,700,000.00	1,724,769.53
1.875 T-NOTE 200630	2,500,000.00	2,584,765.62
1.875 T-NOTE 211130	700,000.00	725,484.37
1.875 T-NOTE 220531	100,000.00	103,562.50
1.875 T-NOTE 220831	1,100,000.00	1,138,414.06
1.875 T-NOTE 221031	1,400,000.00	1,448,125.00
2 T-NOTE 200731	900,000.00	934,945.31
2 T-NOTE 200930	1,000,000.00	1,039,609.37
2 T-NOTE 201130	800,000.00	831,875.00
2 T-NOTE 210228	700,000.00	728,437.50
2 T-NOTE 210531	1,600,000.00	1,666,812.49
2 T-NOTE 210831	1,100,000.00	1,146,449.21
2 T-NOTE 211031	1,100,000.00	1,146,492.18
2 T-NOTE 211115	1,500,000.00	1,563,750.00
2 T-NOTE 220215	1,400,000.00	1,459,500.00
2 T-NOTE 220731	1,800,000.00	1,876,500.00
2 T-NOTE 221130	1,300,000.00	1,354,437.50
2 T-NOTE 230215	3,550,000.00	3,701,707.02
2 T-NOTE 250215	2,500,000.00	2,602,343.75
2 T-NOTE 250815	3,400,000.00	3,537,859.36
2.125 T-NOTE 200831	1,600,000.00	1,670,625.00
2.125 T-NOTE 210131	100,000.00	104,554.68
2.125 T-NOTE 210630	1,400,000.00	1,467,156.25
2.125 T-NOTE 210815	1,700,000.00	1,782,078.12
2.125 T-NOTE 210930	1,400,000.00	1,467,812.50
2.125 T-NOTE 211231	500,000.00	524,609.37
2.125 T-NOTE 220630	2,400,000.00	2,518,875.00
2.125 T-NOTE 221231	700,000.00	734,453.12
2.125 T-NOTE 250515	2,700,000.00	2,837,953.12
2.25 T-NOTE 171130	900,000.00	918,421.87
2.25 T-NOTE 180731	800,000.00	824,000.00
2.25 T-NOTE 210331	200,000.00	210,468.75
2.25 T-NOTE 210430	1,200,000.00	1,263,281.25
2.25 T-NOTE 210731	1,600,000.00	1,686,875.00
2.25 T-NOTE 241115	2,000,000.00	2,121,718.73
2.25 T-NOTE 251115	3,500,000.00	3,717,382.81
2.375 T-NOTE 170731	1,600,000.00	1,626,875.00
2.375 T-NOTE 180531	100,000.00	102,984.37
2.375 T-NOTE 201231	1,800,000.00	1,900,546.87

2.375 T-NOTE 240815	2,100,000.00	2,247,164.06
2.5 T-BOND 450215	2,650,000.00	2,784,156.25
2.5 T-BOND 460215	900,000.00	945,421.87
2.5 T-BOND 460515	600,000.00	631,406.25
2.5 T-NOTE 230815	2,000,000.00	2,152,656.25
2.5 T-NOTE 240515	2,000,000.00	2,158,125.00
2.625 T-NOTE 180131	1,000,000.00	1,028,398.43
2.625 T-NOTE 180430	700,000.00	722,968.75
2.625 T-NOTE 200815	2,200,000.00	2,341,195.31
2.625 T-NOTE 201115	1,200,000.00	1,279,031.25
2.75 T-BOND 420815	350,000.00	388,554.68
2.75 T-BOND 421115	1,300,000.00	1,441,171.87
2.75 T-NOTE 171231	500,000.00	514,238.28
2.75 T-NOTE 180228	600,000.00	619,148.43
2.75 T-NOTE 190215	1,000,000.00	1,049,453.12
2.75 T-NOTE 231115	2,100,000.00	2,299,828.12
2.75 T-NOTE 240215	1,500,000.00	1,644,726.55
2.875 T-BOND 430515	2,600,000.00	2,947,343.75
2.875 T-BOND 450815	1,400,000.00	1,584,406.25
2.875 T-NOTE 180331	500,000.00	517,636.71
3 T-BOND 420515	200,000.00	232,531.24
3 T-BOND 441115	2,300,000.00	2,664,765.62
3 T-BOND 450515	2,100,000.00	2,433,539.06
3 T-BOND 451115	1,500,000.00	1,739,531.25
3.125 T-BOND 411115	600,000.00	712,898.43
3.125 T-BOND 420215	250,000.00	297,226.56
3.125 T-BOND 430215	1,900,000.00	2,256,695.31
3.125 T-BOND 440815	2,250,000.00	2,669,589.84
3.125 T-NOTE 190515	800,000.00	850,718.74
3.125 T-NOTE 210515	1,600,000.00	1,749,562.49
3.375 T-BOND 440515	2,050,000.00	2,546,164.06
3.375 T-NOTE 191115	500,000.00	539,863.28
3.5 T-BOND 390215	350,000.00	442,996.09
3.5 T-NOTE 180215	700,000.00	729,503.90
3.5 T-NOTE 200515	1,400,000.00	1,530,484.37
3.625 T-BOND 430815	1,300,000.00	1,687,664.06
3.625 T-BOND 440215	1,300,000.00	1,686,140.62
3.625 T-NOTE 190815	700,000.00	757,777.34
3.625 T-NOTE 200215	1,900,000.00	2,076,640.62
3.625 T-NOTE 210215	1,900,000.00	2,113,378.90
3.75 T-BOND 410815	750,000.00	983,613.27
3.75 T-BOND 431115	200,000.00	265,500.00
3.75 T-NOTE 181115	1,800,000.00	1,921,992.18
3.875 T-BOND 400815	800,000.00	1,065,687.50
3.875 T-NOTE 180515	700,000.00	739,621.09
4 T-NOTE 180815	1,300,000.00	1,387,292.96
4.25 T-BOND 390515	400,000.00	560,187.50
4.25 T-BOND 401115	550,000.00	772,964.83
4.25 T-NOTE 171115	1,500,000.00	1,567,910.15
4.375 T-BOND 380215	500,000.00	714,257.81
4.375 T-BOND 391115	300,000.00	427,710.93
4.375 T-BOND 400515	800,000.00	1,141,375.00
4.375 T-BOND 410515	800,000.00	1,147,250.00
4.5 T-BOND 360215	550,000.00	791,785.14
4.5 T-BOND 380515	300,000.00	435,914.06
4.5 T-BOND 390815	700,000.00	1,013,414.06
4.625 T-BOND 400215	850,000.00	1,253,019.52
4.75 T-BOND 410215	400,000.00	602,343.75
4.75 T-NOTE 170815	1,000,000.00	1,041,289.06
5 T-BOND 370515	300,000.00	460,875.00
5.25 T-BOND 281115	300,000.00	419,765.62
5.25 T-BOND 290215	50,000.00	70,306.64
5.375 T-BOND 310215	600,000.00	886,546.87
5.5 T-BOND 280815	100,000.00	142,070.31
6 T-BOND 260215	1,800,000.00	2,519,578.11
6.125 T-BOND 271115	300,000.00	439,945.31
6.25 T-BOND 230815	150,000.00	199,359.37

	6.25 T-BOND 300515	500,000.00	782,148.43
	6.5 T-BOND 261115	400,000.00	588,531.25
	8 T-BOND 211115	600,000.00	809,718.75
	8.125 T-BOND 190815	300,000.00	365,039.06
	8.75 T-BOND 200815	700,000.00	914,375.00
	8.875 T-BOND 190215	600,000.00	721,851.56
	国債証券 小計	254,350,000.00	270,732,141.70 (27,511,800,239)
アメリカドル 小計		254,350,000.00	270,732,141.70 (27,511,800,239)
カナダドル			
国債証券	0.25 CAN GOVT 171101	300,000.00	299,079.00
	0.25 CAN GOVT 180501	200,000.00	199,154.00
	0.75 CAN GOVT 200901	600,000.00	604,770.00
	0.75 CAN GOVT 210301	400,000.00	403,160.00
	0.75 CAN GOVT 210901	500,000.00	503,620.00
	1.25 CAN GOVT 170801	300,000.00	302,142.00
	1.25 CAN GOVT 180201	400,000.00	404,360.00
	1.25 CAN GOVT 180301	800,000.00	809,368.00
	1.25 CAN GOVT 180901	400,000.00	406,408.00
	1.5 CAN GOVT 170901	900,000.00	909,378.00
	1.5 CAN GOVT 200301	500,000.00	517,515.00
	1.5 CAN GOVT 230601	500,000.00	525,285.00
	1.5 CAN GOVT 260601	500,000.00	523,025.00
	1.75 CAN GOVT 190301	500,000.00	516,415.00
	1.75 CAN GOVT 190901	300,000.00	311,352.00
	2.25 CAN GOVT 250601	500,000.00	556,855.00
	2.5 CAN GOVT 240601	550,000.00	620,059.00
	2.75 CAN GOVT 220601	550,000.00	615,164.00
	2.75 CAN GOVT 481201	310,000.00	396,790.70
	2.75 CANADA GOVER 641201	170,000.00	235,944.70
	3.25 CAN GOVT 210601	450,000.00	507,001.50
	3.5 CAN GOVT 200601	500,000.00	556,050.00
	3.5 CAN GOVT 451201	590,000.00	846,945.00
	3.75 CAN GOVT 190601	1,000,000.00	1,091,500.00
	4 CAN GOVT 410601	800,000.00	1,183,416.00
	4.25 CAN GOVT 180601	800,000.00	854,008.00
	5 CAN GOVT 370601	450,000.00	718,191.00
	5.75 CAN GOVT 290601	470,000.00	717,422.10
	5.75 CAN GOVT 330601	520,000.00	845,728.00
	8 CAN GOVT 270601	50,000.00	85,015.00
	国債証券 小計	14,810,000.00	17,065,121.00 (1,325,277,296)
カナダドル 小計		14,810,000.00	17,065,121.00 (1,325,277,296)
オーストラリアドル			
国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	600,000.00	606,234.00
	2.25 AUST GOVT 280521	150,000.00	152,319.00
	2.75 AUST GOVT 191021	850,000.00	884,756.50
	2.75 AUST GOVT 240421	1,100,000.00	1,172,061.00
	2.75 AUST GOVT 271121	500,000.00	535,125.00
	2.75 AUST GOVT 350621	250,000.00	259,272.50
	3.25 AUST GOVT 181021	500,000.00	519,035.00
	3.25 AUST GOVT 250421	1,000,000.00	1,107,440.00
	3.25 AUST GOVT 290421	650,000.00	728,741.00
	3.25 AUST GOVT 390621	170,000.00	187,309.40
	3.75 AUST GOVT 370421	380,000.00	452,690.20
	4.25 AUST GOVT 260421	1,100,000.00	1,323,212.00
	4.5 AUST GOVT 200415	900,000.00	998,280.00
	4.5 AUST GOVT 330421	400,000.00	518,756.00
	4.75 AUST GOVT 270421	1,000,000.00	1,264,100.00
	5.25 AUST GOVT 190315	1,000,000.00	1,096,770.00
	5.5 AUST GOVT 180121	800,000.00	845,760.00
	5.5 AUST GOVT 230421	900,000.00	1,113,129.00
	5.75 AUST GOVT 210515	1,000,000.00	1,192,010.00
	5.75 AUST GOVT 220715	850,000.00	1,045,712.50
	国債証券 小計	14,100,000.00	16,002,713.10 (1,250,291,974)

オーストラリアドル 小計		14,100,000.00	16,002,713.10 (1,250,291,974)
イギリスポンド			
国債証券	1 GILT 170907	1,100,000.00	1,110,285.00
	1.25 GILT 180722	1,200,000.00	1,226,700.00
	1.5 GILT 210122	500,000.00	529,700.00
	1.5 GILT 260722	450,000.00	485,280.00
	1.75 GILT 190722	1,200,000.00	1,258,680.00
	1.75 GILT 220907	1,000,000.00	1,089,750.00
	2 GILT 200722	1,400,000.00	1,503,740.00
	2 GILT 250907	900,000.00	1,012,635.00
	2.25 GILT 230907	800,000.00	906,240.00
	2.5 GILT 650722	180,000.00	262,800.00
	2.75 GILT 240907	1,000,000.00	1,180,700.00
	3.25 GILT 440122	1,150,000.00	1,635,760.00
	3.5 GILT 450122	680,000.00	1,016,906.00
	3.5 GILT 680722	1,090,000.00	2,028,926.00
	3.75 GILT 190907	450,000.00	501,750.00
	3.75 GILT 200907	1,300,000.00	1,495,585.00
	3.75 GILT 210907	700,000.00	827,470.00
	3.75 GILT 520722	670,000.00	1,143,187.50
	4 GILT 220307	650,000.00	787,670.00
	4 GILT 600122	340,000.00	655,741.00
	4.25 GILT 271207	300,000.00	412,320.00
	4.25 GILT 320607	900,000.00	1,318,680.00
	4.25 GILT 360307	980,000.00	1,494,941.00
	4.25 GILT 390907	470,000.00	741,331.00
	4.25 GILT 401207	850,000.00	1,360,850.00
	4.25 GILT 461207	850,000.00	1,455,837.50
	4.25 GILT 491207	630,000.00	1,127,227.50
	4.25 GILT 551207	470,000.00	904,703.00
	4.5 GILT 190307	700,000.00	780,920.00
	4.5 GILT 340907	700,000.00	1,078,945.00
	4.5 GILT 421207	950,000.00	1,609,775.00
	4.75 GILT 200307	700,000.00	818,545.00
	4.75 GILT 301207	700,000.00	1,058,400.00
	4.75 GILT 381207	570,000.00	950,902.50
	5 GILT 180307	700,000.00	754,425.00
	5 GILT 250307	650,000.00	894,725.00
	6 GILT 281207	630,000.00	1,013,827.50
	8 GILT 210607	550,000.00	758,532.50
国債証券 小計		29,060,000.00	39,194,393.00 (5,196,784,567)
イギリスポンド 小計		29,060,000.00	39,194,393.00 (5,196,784,567)
スイスフラン			
国債証券	2 SWISS GOVT 210428	180,000.00	204,903.00
	2.25 SWISS GOVT 200706	220,000.00	247,874.00
	3 SWISS GOVT 180108	230,000.00	242,420.00
	3 SWISS GOVT 190512	110,000.00	122,144.00
	4 SWISS GOVT 230211	170,000.00	223,703.00
	4 SWISS GOVT 280408	240,000.00	367,368.00
国債証券 小計		1,150,000.00	1,408,412.00 (146,024,156)
スイスフラン 小計		1,150,000.00	1,408,412.00 (146,024,156)
シンガポールドル			
国債証券	0.5 SINGAPORGOVT 180401	200,000.00	198,700.00
	1.375 SINGAPORGOV 171001	130,000.00	130,787.80
	1.625 SINGAPORGOV 191001	50,000.00	50,825.00
	2 SINGAPORGOVT 200701	150,000.00	154,725.00
	2.125 SINGAPORGOV 260601	70,000.00	71,820.00
	2.25 SINGAPORGOVT 210601	290,000.00	301,600.00
	2.375 SINGAPORGOV 250601	50,000.00	52,350.00
	2.5 SINGAPORGOVT 190601	220,000.00	228,844.00
	2.75 SINGAPORGOVT 230701	130,000.00	139,425.00
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	230,000.00	251,735.00
	2.75 SINGAPORGOVT 460301	50,000.00	54,725.00

	2.875 SINGAPORGOV 290701	100,000.00	109,200.00	
	2.875SINGAPORGOVT 300901	160,000.00	174,720.00	
	3 SINGAPORGOVT 240901	300,000.00	328,050.00	
	3.125SINGAPORGOVT 220901	200,000.00	218,900.00	
	3.25 SINGAPORGOVT 200901	170,000.00	183,430.00	
	3.375 SINGAPORGOV 330901	110,000.00	128,150.00	
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	200,000.00	230,200.00	
	4 SINGAPORGOVT 180901	160,000.00	170,096.00	
	国債証券 小計	2,970,000.00	3,178,282.80 (240,627,790)	
	シンガポールドル 小計	2,970,000.00	3,178,282.80 (240,627,790)	
	マレーシアリングgit			
国債証券	3.26 MALAYSIAGOV 180301	400,000.00	403,872.00	
	3.314 MALAYSIA 171031	600,000.00	605,190.00	
	3.418MALAYSIAGOV 220815	350,000.00	349,023.50	
	3.48 MALAYSIAGOV 230315	500,000.00	498,270.00	
	3.492 MALAYSIAGOV 200331	700,000.00	706,076.00	
	3.502MALAYSIAGOV 270531	500,000.00	480,945.00	
	3.654 MALAYSIAGOV 191031	200,000.00	203,316.00	
	3.733 MALAYSIAGO 280615	100,000.00	97,490.00	
	3.759 MALAYSIAGOV 190315	100,000.00	101,927.00	
	3.795 MALAYSIAGOV 220930	500,000.00	508,700.00	
	3.8 MALAYSIAGOV 230817	300,000.00	305,775.00	
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	200,000.00	189,002.00	
	3.889 MALAYSIAGO 200731	600,000.00	614,214.00	
	3.892 MALAYSIAGOV 270315	450,000.00	449,230.50	
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	500,000.00	508,890.00	
	4.012 MALAYSIAGOV 170915	500,000.00	507,735.00	
	4.048 MALAYSIA 210930	600,000.00	620,616.00	
	4.127 MALAYSIA 320415	500,000.00	491,980.00	
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	400,000.00	415,092.00	
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	500,000.00	518,860.00	
	4.232MALAYSIAGOV 310630	200,000.00	205,864.00	
	4.24 MALAYSIAGOV 180207	800,000.00	818,840.00	
	4.254 MALAYSIAGOV 350531	200,000.00	200,922.00	
	4.378MALAYSIAGOV 191129	900,000.00	934,380.00	
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	300,000.00	315,120.00	
	4.498 MALAYSIAGOV 300415	500,000.00	523,805.00	
	4.736 MALAYSIAGOV 460315	100,000.00	103,327.00	
	4.935 MALAYSIAGOV 430930	400,000.00	420,296.00	
	5.734MALAYSIAGOV 190730	300,000.00	322,422.00	
	国債証券 小計	12,200,000.00	12,421,180.00 (314,628,489)	
	マレーシアリングgit 小計	12,200,000.00	12,421,180.00 (314,628,489)	
	スウェーデンクローネ			
国債証券	1 SWD GOVT 261112	2,100,000.00	2,288,643.00	
	1.5 SWD GOVT 231113	3,100,000.00	3,498,195.00	
	2.5 SWD GOVT 250512	2,300,000.00	2,823,940.00	
	3.5 SWD GOVT 220601	3,500,000.00	4,297,090.00	
	3.5 SWD GOVT 390330	1,800,000.00	2,723,814.00	
	3.75 SWD GOVT 170812	2,100,000.00	2,194,584.00	
	4.25 SWD GOVT 190312	4,000,000.00	4,512,960.00	
	5 SWD GOVT 201201	3,700,000.00	4,592,292.00	
	国債証券 小計	22,600,000.00	26,931,518.00 (321,562,324)	
	スウェーデンクローネ 小計	22,600,000.00	26,931,518.00 (321,562,324)	
	ノルウェークローネ			
国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	1,150,000.00	1,199,565.00	
	1.75 NORWE GOVT 250313	1,600,000.00	1,704,080.00	
	2 NORWE GOVT 230524	2,100,000.00	2,269,680.00	
	3 NORWE GOVT 240314	1,700,000.00	1,970,470.00	
	3.75 NORWE GOVT 210525	2,900,000.00	3,326,590.00	
	4.5 NORWE GOVT 190522	2,600,000.00	2,884,310.00	
	国債証券 小計	12,050,000.00	13,354,695.00 (162,125,997)	

ノルウェークローネ 小計		12,050,000.00	13,354,695.00 (162,125,997)
デンマーククローネ			
国債証券	0.25 DMK GOVT 181115	1,500,000.00	1,527,300.00
	1.5 DMK GOVT 231115	2,700,000.00	3,024,135.00
	1.75 DMK GOVT 251115	3,000,000.00	3,466,200.00
	3 DMK GOVT 211115	3,800,000.00	4,469,750.00
	4 DMK GOVT 171115	1,700,000.00	1,800,045.00
	4 DMK GOVT 191115	3,800,000.00	4,359,550.00
	4.5 DMK GOVT 391115	5,000,000.00	9,388,250.00
	7 DMK GOVT 241110	800,000.00	1,275,880.00
国債証券 小計		22,300,000.00	29,311,110.00 (446,115,094)
デンマーククローネ 小計		22,300,000.00	29,311,110.00 (446,115,094)
メキシコペソ			
国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	11,200,000.00	14,294,000.00
	10 MEXICAN BONOS 361120	2,200,000.00	3,095,180.00
	4.75 MEXICAN BONO 180614	7,600,000.00	7,549,384.00
	5 MEXICAN BONOS 191211	5,400,000.00	5,329,314.00
	5.75 MEXICAN BONO 260305	1,800,000.00	1,779,948.00
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	9,300,000.00	9,650,610.00
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	4,500,000.00	4,677,390.00
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	3,300,000.00	3,681,975.00
	7.75 MEXICAN BONO 171214	3,000,000.00	3,120,060.00
	7.75 MEXICAN BONO 310529	5,600,000.00	6,389,600.00
	7.75 MEXICAN BONO 341123	3,400,000.00	3,891,232.00
	7.75 MEXICAN BONO 421113	5,900,000.00	6,865,004.00
	8 MEXICAN BONOS 200611	5,900,000.00	6,412,415.00
	8 MEXICAN BONOS 231207	3,000,000.00	3,401,280.00
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	11,700,000.00	12,527,190.00
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	3,900,000.00	4,703,361.00
8.5 MEXICAN BONOS 381118	4,500,000.00	5,575,770.00	
国債証券 小計		92,200,000.00	102,943,713.00 (567,219,858)
メキシコペソ 小計		92,200,000.00	102,943,713.00 (567,219,858)
ポーランドズロチ			
国債証券	1.5 POLAND 200425	900,000.00	885,015.00
	1.75 POLAND 210725	200,000.00	195,990.00
	2 POLAND 210425	1,100,000.00	1,095,820.00
	2.5 POLAND 180725	900,000.00	914,040.00
	2.5 POLAND 260725	1,100,000.00	1,080,860.00
	3.25 POLAND 190725	800,000.00	832,720.00
	3.25 POLAND 250725	1,150,000.00	1,204,567.50
	3.75 POLAND 180425	900,000.00	931,680.00
	4 POLAND 231025	1,100,000.00	1,211,650.00
	5.25 POLAND 171025	1,100,000.00	1,147,410.00
	5.25 POLAND 201025	1,000,000.00	1,128,900.00
	5.5 POLAND 191025	800,000.00	890,120.00
	5.75 POLAND 211025	500,000.00	586,300.00
	5.75 POLAND 220923	1,000,000.00	1,194,400.00
	5.75 POLAND 290425	500,000.00	646,300.00
	POLAND 181025	300,000.00	289,080.00
国債証券 小計		13,350,000.00	14,234,852.50 (377,935,333)
ポーランドズロチ 小計		13,350,000.00	14,234,852.50 (377,935,333)
南アフリカランド			
国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	6,800,000.00	7,701,544.00
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	3,500,000.00	2,608,970.00
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	3,700,000.00	2,758,054.00
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	2,300,000.00	2,184,172.00
	7 SOUTH AFRICA 310228	4,100,000.00	3,457,735.00
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	2,300,000.00	2,253,839.00
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	2,400,000.00	2,336,400.00
	8 SOUTH AFRICA 181221	2,200,000.00	2,211,704.00
	8 SOUTH AFRICA 300131	3,000,000.00	2,788,770.00

8.25 SOUTH AFRICA 170915	1,500,000.00	1,510,590.00	
8.25 SOUTH AFRICA 320331	3,000,000.00	2,808,780.00	
8.5 SOUTH AFRICA 370131	3,500,000.00	3,299,205.00	
8.75 SOUTH AFRICA 440131	2,300,000.00	2,199,904.00	
8.75 SOUTH AFRICA 480228	4,600,000.00	4,397,968.00	
8.875 SOUTH AFRIC 350228	800,000.00	784,488.00	
9 SOUTH AFRICA 400131	500,000.00	491,960.00	
国債証券 小計	46,500,000.00	43,794,083.00	(332,835,030)
南アフリカランド 小計	46,500,000.00	43,794,083.00	(332,835,030)
ユーロ			
国債証券			
0 BUND 260815	150,000.00	151,153.50	
0 NETH GOVT 180415	300,000.00	302,922.00	
0 O.A.T 180225	100,000.00	100,863.00	
0 O.A.T 190225	200,000.00	202,842.00	
0 O.A.T 200525	700,000.00	713,118.00	
0 O.A.T 210525	200,000.00	203,972.00	
0 OBL 200417	1,100,000.00	1,126,257.00	
0 OBL 210409	600,000.00	615,918.00	
0 SCHATS 170915	500,000.00	503,370.00	
0 SCHATS 171215	450,000.00	453,717.00	
0.1 ITALY GOVT 190415	100,000.00	100,330.00	
0.25 ITALY GOVT 180515	500,000.00	502,825.00	
0.25 NETH GOVT 200115	500,000.00	514,985.00	
0.25 NETH GOVT 250715	550,000.00	567,165.50	
0.25 O.A.T 201125	600,000.00	618,240.00	
0.25 OBL 180413	1,000,000.00	1,014,890.00	
0.25 OBL 191011	200,000.00	205,798.00	
0.25 OBL 201016	400,000.00	414,556.00	
0.25 SPAIN GOVT 180430	100,000.00	100,715.00	
0.25 SPAIN GOVT 190131	100,000.00	100,845.00	
0.375 FINNISH GOV 200915	250,000.00	259,175.00	
0.45 ITALY GOVT 210601	500,000.00	504,950.00	
0.5 BUND 250215	1,000,000.00	1,067,080.00	
0.5 BUND 260215	700,000.00	742,770.00	
0.5 NETH GOVT 260715	100,000.00	104,815.00	
0.5 O.A.T 191125	1,100,000.00	1,137,213.00	
0.5 O.A.T 250525	1,500,000.00	1,566,030.00	
0.5 O.A.T 260525	400,000.00	413,956.00	
0.5 OBL 171013	700,000.00	709,240.00	
0.5 OBL 180223	1,100,000.00	1,119,074.00	
0.5 OBL 190412	700,000.00	721,861.00	
0.5 SPAIN GOVT 171031	700,000.00	705,985.00	
0.65 ITALY GOVT 201101	100,000.00	102,320.00	
0.7 ITALY GOVT 200501	700,000.00	716,870.00	
0.75 AUSTRIA GOVT 261020	300,000.00	320,541.00	
0.75 FINNISH GOVT 310415	150,000.00	159,829.50	
0.75 ITALY GOVT 180115	600,000.00	607,380.00	
0.75 SPAIN GOVT 210730	300,000.00	309,075.00	
0.8 BEL GOVT 250622	700,000.00	749,231.00	
0.8 IRISH GOVT 220315	200,000.00	210,790.00	
0.875 FINNISH GOV 250915	100,000.00	108,143.00	
0.95 ITALY GOVT 230315	400,000.00	409,660.00	
1 BEL GOVT 260622	50,000.00	54,186.00	
1 BEL GOVT 310622	300,000.00	321,309.00	
1 BUND 240815	1,000,000.00	1,108,230.00	
1 BUND 250815	900,000.00	998,874.00	
1 O.A.T 180525	1,100,000.00	1,130,800.00	
1 O.A.T 181125	1,100,000.00	1,139,622.00	
1 O.A.T 190525	700,000.00	730,401.00	
1 O.A.T 251125	800,000.00	869,088.00	
1 OBL 181012	700,000.00	725,081.00	
1 OBL 190222	900,000.00	938,187.00	
1.05 ITALY GOVT 191201	800,000.00	827,920.00	
1.125 FINNISH GOV 180915	200,000.00	207,204.00	
1.15 AUSTRIA GOVT 181019	400,000.00	414,924.00	

1.15 SPAIN GOVT 200730	100,000.00	104,530.00
1.2 AUSTRIA GOVT 251020	200,000.00	223,472.00
1.25 NETH GOVT 180115	1,000,000.00	1,026,500.00
1.25 NETH GOVT 190115	400,000.00	418,124.00
1.25 O.A.T 360525	300,000.00	327,798.00
1.35 ITALY GOVT 220415	900,000.00	947,925.00
1.4 SPAIN GOVT 200131	1,400,000.00	1,468,530.00
1.45 ITALY GOVT 220915	500,000.00	529,400.00
1.5 BUND 220904	800,000.00	898,608.00
1.5 BUND 230215	1,000,000.00	1,130,020.00
1.5 BUND 230515	200,000.00	226,908.00
1.5 BUND 240515	800,000.00	917,952.00
1.5 FINNISH GOVT 230415	100,000.00	112,222.00
1.5 ITALY GOVT 190801	600,000.00	627,150.00
1.5 ITALY GOVT 250601	900,000.00	941,625.00
1.5 O.A.T 310525	500,000.00	572,345.00
1.6 ITALY GOVT 260601	500,000.00	522,375.00
1.6 SPAIN GOVT 250430	1,000,000.00	1,063,000.00
1.625 FINNISH GOV 220915	200,000.00	224,838.00
1.65 AUSTRIA GOVT 241021	700,000.00	806,491.00
1.75 AUSTRIA GOVT 231020	300,000.00	345,915.00
1.75 BUND 220704	1,200,000.00	1,362,324.00
1.75 BUND 240215	1,100,000.00	1,280,125.00
1.75 NETH GOVT 230715	500,000.00	573,845.00
1.75 O.A.T 230525	1,400,000.00	1,593,172.00
1.75 O.A.T 241125	1,300,000.00	1,496,885.00
1.95 AUSTRIA GOVT 190618	400,000.00	428,624.00
1.95 SPAIN GOVT 260430	1,150,000.00	1,250,337.50
1.95 SPAIN GOVT 300730	400,000.00	432,160.00
2 BUND 220104	800,000.00	910,608.00
2 BUND 230815	300,000.00	352,176.00
2 FINNISH GOVT 240415	100,000.00	117,173.00
2 IRISH GOVT 450218	300,000.00	362,460.00
2 ITALY GOVT 251201	600,000.00	650,700.00
2 NETH GOVT 240715	800,000.00	942,344.00
2.15 ITALY GOVT 211215	800,000.00	877,000.00
2.15 SPAIN GOVT 251031	500,000.00	553,175.00
2.25 BEL GOVT 230622	500,000.00	589,350.00
2.25 BUND 200904	800,000.00	895,432.00
2.25 BUND 210904	650,000.00	743,853.50
2.25 ITALY GOVT 360901	50,000.00	54,425.00
2.25 NETH GOVT 220715	600,000.00	697,008.00
2.25 O.A.T 221025	1,100,000.00	1,277,078.00
2.25 O.A.T 240525	1,400,000.00	1,663,704.00
2.4 AUSTRIA GOVT 340523	150,000.00	200,142.00
2.4 IRISH GOVT 300515	350,000.00	429,240.00
2.5 BUND 210104	800,000.00	910,688.00
2.5 BUND 440704	800,000.00	1,242,832.00
2.5 BUND 460815	650,000.00	1,027,708.50
2.5 ITALY GOVT 190501	700,000.00	748,055.00
2.5 ITALY GOVT 241201	900,000.00	1,014,570.00
2.5 NETH GOVT 330115	500,000.00	683,830.00
2.5 O.A.T 201025	1,900,000.00	2,140,825.00
2.5 O.A.T 300525	1,600,000.00	2,051,632.00
2.6 BEL GOVT 240622	800,000.00	974,376.00
2.625 FINNISH GOV 420704	250,000.00	377,997.50
2.7 ITALY GOVT 470301	350,000.00	400,347.50
2.75 FINNISH GOVT 280704	200,000.00	262,840.00
2.75 NETH GOVT 470115	450,000.00	735,057.00
2.75 O.A.T 271025	1,150,000.00	1,470,735.00
2.75 SPAIN GOVT 190430	700,000.00	753,865.00
2.75 SPAIN GOVT 241031	1,200,000.00	1,385,640.00
2.9 SPAIN GOVT 461031	400,000.00	477,300.00
3 BEL GOVT 190928	500,000.00	556,590.00
3 BEL GOVT 340622	300,000.00	423,282.00
3 BUND 200704	1,300,000.00	1,486,511.00
3 O.A.T 220425	1,500,000.00	1,791,555.00

3.15 AUSTRIA GOVT 440620	300,000.00	488,145.00
3.25 BUND 200104	1,000,000.00	1,134,590.00
3.25 BUND 210704	600,000.00	713,934.00
3.25 BUND 420704	550,000.00	939,433.00
3.25 ITALY GOVT 460901	600,000.00	764,520.00
3.25 NETH GOVT 210715	700,000.00	831,201.00
3.25 O.A.T 211025	1,550,000.00	1,848,421.50
3.25 O.A.T 450525	650,000.00	1,031,374.50
3.375 FINNISH GOV 200415	200,000.00	229,178.00
3.4 AUSTRIA GOVT 221122	300,000.00	372,441.00
3.4 IRISH GOVT 240318	300,000.00	374,235.00
3.5 AUSTRIA GOVT 210915	600,000.00	722,616.00
3.5 BUND 190704	700,000.00	785,204.00
3.5 FINNISH GOVT 210415	300,000.00	356,586.00
3.5 ITALY GOVT 171101	1,000,000.00	1,044,400.00
3.5 ITALY GOVT 180601	1,000,000.00	1,064,300.00
3.5 ITALY GOVT 181201	1,100,000.00	1,190,475.00
3.5 ITALY GOVT 300301	1,150,000.00	1,454,117.50
3.5 NETH GOVT 200715	700,000.00	813,862.00
3.5 O.A.T 200425	1,800,000.00	2,070,432.00
3.5 O.A.T 260425	1,950,000.00	2,593,851.00
3.65 AUSTRIA GOVT 220420	500,000.00	617,345.00
3.75 BEL GOVT 200928	800,000.00	944,200.00
3.75 BEL GOVT 450622	400,000.00	689,960.00
3.75 BUND 190104	700,000.00	774,676.00
3.75 ITALY GOVT 210301	1,100,000.00	1,278,695.00
3.75 ITALY GOVT 210501	600,000.00	699,210.00
3.75 ITALY GOVT 210801	800,000.00	938,880.00
3.75 ITALY GOVT 240901	700,000.00	856,205.00
3.75 NETH GOVT 230115	550,000.00	699,011.50
3.75 NETH GOVT 420115	650,000.00	1,176,519.50
3.75 O.A.T 191025	1,350,000.00	1,536,961.50
3.75 O.A.T 210425	1,600,000.00	1,919,440.00
3.75 SPAIN GOVT 181031	1,200,000.00	1,304,280.00
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	150,000.00	306,373.50
3.8 SPAIN GOVT 240430	1,000,000.00	1,230,150.00
3.875 FINNISH GOVT170915	300,000.00	314,643.00
3.9 AUSTRIA GOVT 200715	700,000.00	822,850.00
3.9 IRISH GOVT 230320	200,000.00	252,150.00
4 BEL GOVT 180328	700,000.00	752,682.00
4 BEL GOVT 190328	600,000.00	673,410.00
4 BEL GOVT 220328	800,000.00	1,003,824.00
4 BEL GOVT 320328	350,000.00	536,427.50
4 BUND 180104	700,000.00	745,759.00
4 BUND 370104	1,050,000.00	1,833,898.50
4 FINNISH GOVT 250704	350,000.00	478,628.50
4 ITALY GOVT 200901	1,000,000.00	1,158,800.00
4 ITALY GOVT 370201	1,000,000.00	1,384,900.00
4 NETH GOVT 180715	700,000.00	762,384.00
4 NETH GOVT 190715	600,000.00	681,816.00
4 NETH GOVT 370115	550,000.00	953,573.50
4 O.A.T 180425	1,500,000.00	1,617,450.00
4 O.A.T 381025	750,000.00	1,247,257.50
4 O.A.T 550425	520,000.00	994,125.60
4 O.A.T 600425	600,000.00	1,179,966.00
4 SPAIN GOVT 200430	1,200,000.00	1,377,600.00
4.1 SPAIN GOVT 180730	1,100,000.00	1,192,455.00
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	500,000.00	856,535.00
4.2 SPAIN GOVT 370131	550,000.00	788,425.00
4.25 BEL GOVT 210928	500,000.00	623,440.00
4.25 BEL GOVT 220928	600,000.00	774,174.00
4.25 BEL GOVT 410328	800,000.00	1,420,392.00
4.25 BUND 180704	1,000,000.00	1,093,320.00
4.25 BUND 390704	500,000.00	936,290.00
4.25 ITALY GOVT 190201	1,200,000.00	1,327,740.00
4.25 ITALY GOVT 190901	450,000.00	508,635.00
4.25 ITALY GOVT 200301	1,400,000.00	1,609,090.00

4.25 O.A.T 171025	1,400,000.00	1,481,774.00	
4.25 O.A.T 181025	1,500,000.00	1,660,230.00	
4.25 O.A.T 190425	1,200,000.00	1,357,188.00	
4.25 O.A.T 231025	1,700,000.00	2,256,597.00	
4.3 AUSTRIA GOVT 170915	100,000.00	105,322.00	
4.3 SPAIN GOVT 191031	800,000.00	911,720.00	
4.35 AUSTRIA GOVT 190315	600,000.00	676,902.00	
4.375 FINNISH GOV 190704	300,000.00	343,611.00	
4.4 IRISH GOVT 190618	300,000.00	341,730.00	
4.4 SPAIN GOVT 231031	500,000.00	635,125.00	
4.5 BEL GOVT 260328	400,000.00	572,532.00	
4.5 IRISH GOVT 181018	500,000.00	554,275.00	
4.5 IRISH GOVT 200418	400,000.00	472,440.00	
4.5 ITALY GOVT 180201	1,600,000.00	1,708,400.00	
4.5 ITALY GOVT 180801	900,000.00	980,910.00	
4.5 ITALY GOVT 190301	800,000.00	893,040.00	
4.5 ITALY GOVT 200201	1,000,000.00	1,154,850.00	
4.5 ITALY GOVT 230501	900,000.00	1,132,425.00	
4.5 ITALY GOVT 240301	900,000.00	1,146,240.00	
4.5 ITALY GOVT 260301	800,000.00	1,048,960.00	
4.5 O.A.T 410425	1,550,000.00	2,828,703.50	
4.5 SPAIN GOVT 180131	900,000.00	961,875.00	
4.6 SPAIN GOVT 190730	500,000.00	569,150.00	
4.65 AUSTRIA GOVT 180115	400,000.00	429,792.00	
4.65 SPAIN GOVT 250730	700,000.00	926,275.00	
4.7 SPAIN GOVT 410730	650,000.00	1,017,120.00	
4.75 BUND 280704	300,000.00	473,778.00	
4.75 BUND 340704	800,000.00	1,449,344.00	
4.75 BUND 400704	500,000.00	1,008,300.00	
4.75 ITALY GOVT 210901	1,000,000.00	1,225,400.00	
4.75 ITALY GOVT 230801	1,000,000.00	1,283,700.00	
4.75 ITALY GOVT 280901	850,000.00	1,177,802.50	
4.75 ITALY GOVT 440901	650,000.00	1,031,875.00	
4.75 O.A.T 350425	1,100,000.00	1,901,130.00	
4.8 SPAIN GOVT 240131	800,000.00	1,043,200.00	
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	300,000.00	442,395.00	
4.85 SPAIN GOVT 201031	800,000.00	962,640.00	
4.9 SPAIN GOVT 400730	750,000.00	1,195,387.50	
5 BEL GOVT 350328	1,050,000.00	1,869,294.00	
5 IRISH GOVT 201018	300,000.00	367,305.00	
5 ITALY GOVT 220301	900,000.00	1,128,015.00	
5 ITALY GOVT 250301	1,200,000.00	1,600,680.00	
5 ITALY GOVT 340801	1,400,000.00	2,132,970.00	
5 ITALY GOVT 390801	900,000.00	1,424,655.00	
5 ITALY GOVT 400901	900,000.00	1,431,630.00	
5.15 SPAIN GOVT 281031	700,000.00	1,011,465.00	
5.15 SPAIN GOVT 441031	350,000.00	589,820.00	
5.25 ITALY GOVT 291101	1,350,000.00	1,984,702.50	
5.4 IRISH GOVT 250313	450,000.00	645,322.50	
5.4 SPAIN GOVT 230131	900,000.00	1,185,120.00	
5.5 BEL GOVT 280328	800,000.00	1,286,544.00	
5.5 BUND 310104	700,000.00	1,248,072.00	
5.5 IRISH GOVT 171018	200,000.00	214,130.00	
5.5 ITALY GOVT 220901	800,000.00	1,040,880.00	
5.5 ITALY GOVT 221101	900,000.00	1,174,770.00	
5.5 NETH GOVT 280115	550,000.00	895,075.50	
5.5 O.A.T 290425	1,200,000.00	1,980,948.00	
5.5 SPAIN GOVT 210430	900,000.00	1,129,725.00	
5.625 BUND 280104	700,000.00	1,162,084.00	
5.75 ITALY GOVT 330201	620,000.00	1,001,207.00	
5.75 O.A.T 321025	1,050,000.00	1,909,435.50	
5.75 SPAIN GOVT 320730	800,000.00	1,295,440.00	
5.85 SPAIN GOVT 220131	800,000.00	1,044,760.00	
5.9 IRISH GOVT 191018	300,000.00	360,570.00	
5.9 SPAIN GOVT 260730	300,000.00	437,940.00	
6 ITALY GOVT 310501	800,000.00	1,281,880.00	
6 O.A.T 251025	800,000.00	1,241,544.00	

6 SPAIN GOVT 290131	1,000,000.00	1,552,650.00	
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	200,000.00	336,214.00	
6.25 BUND 240104	250,000.00	376,102.50	
6.25 BUND 300104	400,000.00	739,116.00	
6.5 BUND 270704	400,000.00	692,016.00	
6.5 ITALY GOVT 271101	800,000.00	1,239,160.00	
7.25 ITALY GOVT 261101	400,000.00	635,300.00	
8.5 O.A.T 191025	300,000.00	387,531.00	
8.5 O.A.T 230425	500,000.00	797,775.00	
9 ITALY GOVT 231101	300,000.00	475,230.00	
国債証券 小計	185,440,000.00	231,178,683.60 (26,167,115,196)	
ユーロ 小計	185,440,000.00	231,178,683.60 (26,167,115,196)	
合計		64,360,343,343 (64,360,343,343)	

(注1) 通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 209銘柄	100.00%	42.75%
カナダドル	国債証券 30銘柄	100.00%	2.06%
オーストラリアドル	国債証券 20銘柄	100.00%	1.94%
イギリスポンド	国債証券 38銘柄	100.00%	8.07%
スイスフラン	国債証券 6銘柄	100.00%	0.23%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.00%	0.37%
マレーシアリングgit	国債証券 29銘柄	100.00%	0.49%
スウェーデンクローネ	国債証券 8銘柄	100.00%	0.50%
ノルウェークローネ	国債証券 6銘柄	100.00%	0.25%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.00%	0.69%
メキシコペソ	国債証券 17銘柄	100.00%	0.88%
ポーランドズロチ	国債証券 16銘柄	100.00%	0.59%
南アフリカランド	国債証券 16銘柄	100.00%	0.52%
ユーロ	国債証券 266銘柄	100.00%	40.66%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

2【ファンドの現況】
【純資産額計算書】

平成28年8月31日現在
(単位：円)

資産総額	4,045,353,213
負債総額	3,364,464
純資産総額(-)	4,041,988,749
発行済口数	3,146,608,259 口
1口当たり純資産価額(/)	1.2846 (1万口当たり 12,846)

<参考>

「三菱UFJ 外国債券マザーファンド」の現況
純資産額計算書

平成28年8月31日現在
(単位：円)

資産総額	65,550,493,276
負債総額	233,379,933
純資産総額(-)	65,317,113,343
発行済口数	26,440,850,464 口
1口当たり純資産価額(/)	2.4703 (1万口当たり 24,703)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

したがって、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

（2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

（4）受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（5）受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

（6）受益権の再分割

委託会社は、受託会社と合意のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

（7）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、解約請求の受付け、解約代金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

報告書代替書面における「委託会社等の概況」の記載のとおりです。

報告書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概況】

報告書代替書面における「事業の内容及び営業の概況」の記載のとおりです。

3【委託会社等の経理状況】

報告書代替書面における「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】

報告書代替書面における「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】

報告書代替書面における「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】

報告書代替書面における「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。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

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

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（平成28年3月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (平成28年3月末現在)	事業の内容
株式会社北海道銀行	93,524 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社南都銀行	29,249 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社紀陽銀行	80,096 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社中国銀行	15,149 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社肥後銀行	18,128 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	47,937 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。
常陽証券株式会社	3,000 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。
楽天証券株式会社	7,495 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。
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。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社：ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

(2) 販売会社：ファンドの募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。

3【資本関係】

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28年8月末現在）

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の51.0%（107,855株）を所有しています。

(注) 関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

第3【参考情報】

1 当計算期間において、次の書類を関東財務局長に提出しております。

平成28年5月9日 半期報告書、有価証券届出書の訂正届出書

平成27年11月9日 有価証券報告書、有価証券届出書

2 その他

- (1) 目論見書の表紙にロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、またファンドの形態、申込みに係る事項などを記載することがあります。
- (2) 投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。
- (3) 目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- ・当ファンドの受益権の価額は、公社債等の有価証券市場の相場変動、組入有価証券の発行者の信用状況の変化、為替市場の相場変動等の影響により変動し、下落する場合があります。したがって、投資家のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。
 - ・当ファンドは、一定の運用成果を保証するものではありません。
 - ・運用により信託財産に生じた損益はすべて投資家のみなさまに帰属します。
 - ・投資信託は、預金等や保険契約とは異なり、預金保険機構、貯金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
 - ・金融商品取引業者以外の金融機関は、投資者保護基金に加入しておりません。
 - ・当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
- (4) 目論見書は電磁的方法により提供されるほか、インターネット、電子媒体等に掲載されることがあります。
- (5) 投信評価機関、投信評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。
- (6) 目論見書は「投資信託説明書」を別称として使用します。
- (7) 目論見書に委託会社のホームページアドレスのほか、モバイルサイトのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等を含みます。）等を掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨のご案内を記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成28年9月14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」に掲げられている三菱UFJ 外国債券オープンの平成27年8月11日から平成28年8月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に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財務諸表を作成し適正に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監査に基づいて、独立の立場から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監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、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の手続が実施される。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財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、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監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、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全体としての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、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。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ 外国債券オープンの平成28年8月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に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データは監査の対象に含まれていません。