

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年11月9日提出
【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
【電話番号】	03-6250-4740
【届出の対象とした募集（売出）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（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【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の受益権です。

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。

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：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、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

（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。

申込みには分配金受取コース（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。

（６）【申込単位】

販売会社が定める単位

申込単位は販売会社にご確認ください。

（７）【申込期間】

平成29年11月10日から平成30年11月 9日まで

申込期間は、前記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新される予定です。

(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：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。

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經由して、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です。

(11) 【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【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。

* 委託会社は、受託会社と合意のうえ、信託金の限度額を変更することができます。

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 ()	ETF	
		資産複合		

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	ブル・ベア型
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	TOPIX	条件付運用型
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)))					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 ()
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。商品分類および属性区分の内容に

については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）でご覧いただけます。

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た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）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。

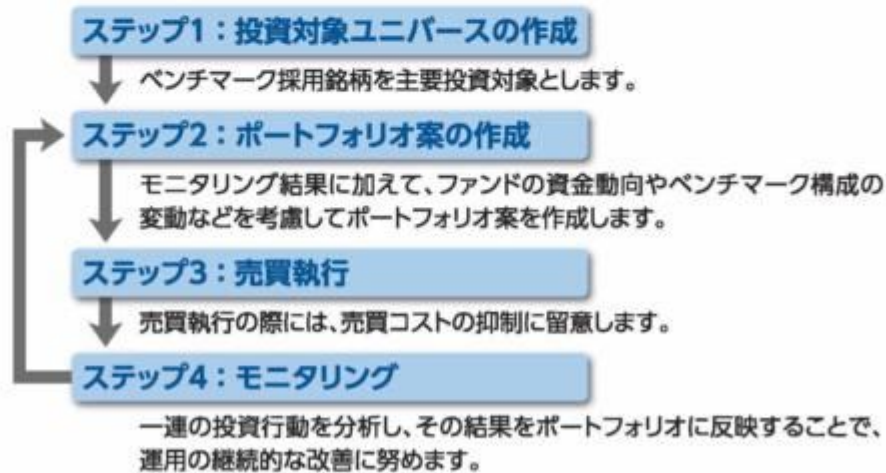
ファンドの特色



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か国で構成されています(2017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]、S&Pグローバル・レーティング(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・利息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

投資家 (受益者)	
お申込金	収益分配金、解約代金等
販売会社	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。
お申込金	収益分配金、解約代金等
受託会社 (受託者) 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)	委託会社 (委託者) 三菱UFJ国際投信株式会社

信託財産の保管・管理等を行います。

投資 損益

マザーファンド

投資 損益

有価証券等

信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。

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 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	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（平成29年8月末現在）

- ・金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・設立年月日
昭和60年8月1日
- ・資本金
2,000百万円
- ・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

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、

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券

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せん。）
 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せん。）
 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ません。

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。

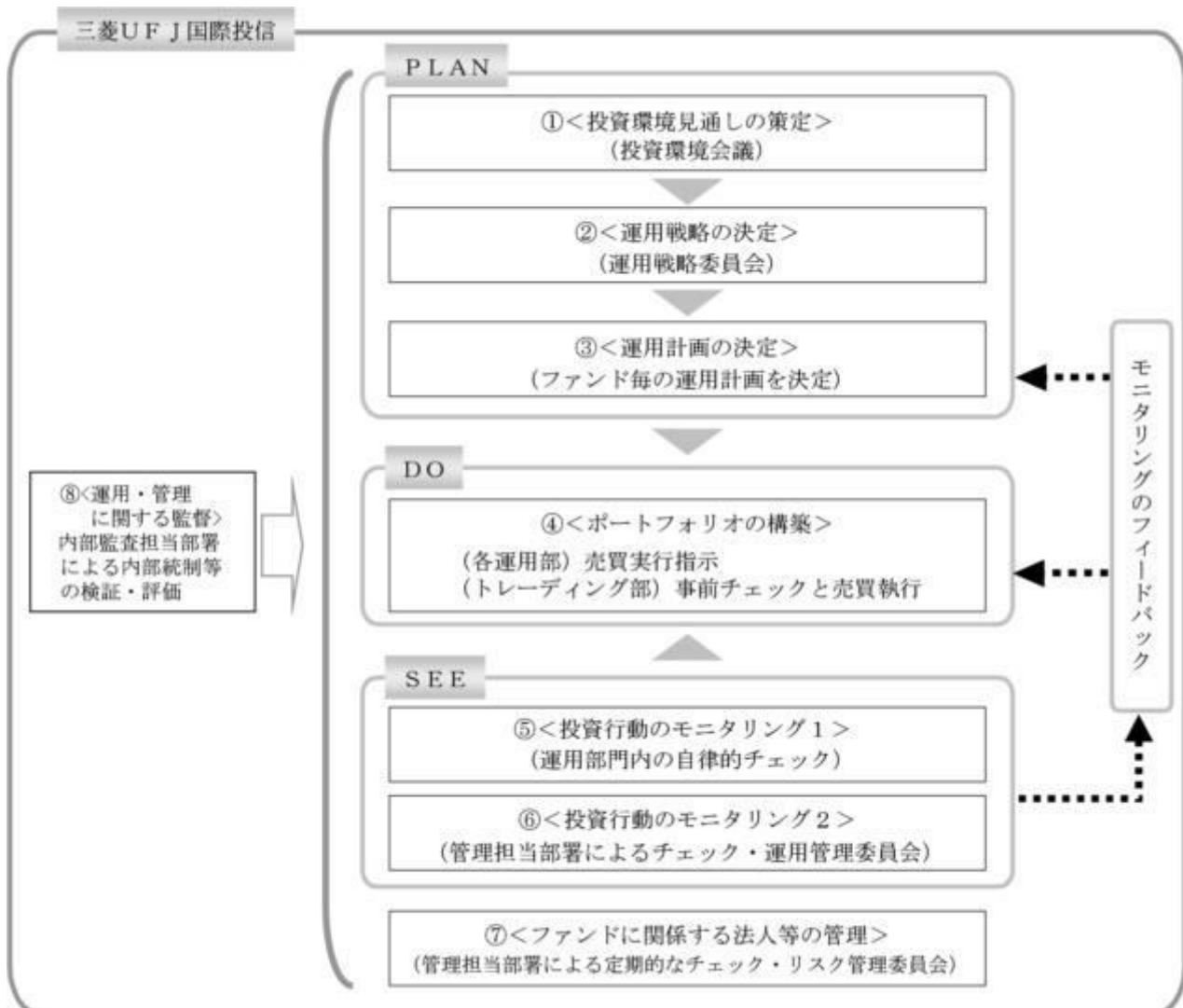
同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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ージャーは、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（40～60名程度）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。

なお、委託会社に関する「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でご覧いただけます。

「運用担当者に係る事項」 <http://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>

（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、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ます。
- 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ます。

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ます。
- 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ます。

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

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。

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。

(主なりスクであり、以下に限定されるものではありません。)

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

委託会社では、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とともに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います。また、定期的に関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。この内容は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。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

トレーディング担当部署

有価証券等の売買執行および発注に係る法令等の遵守および監視・牽制を行います。

コンプライアンス担当部署

法令上の禁止行為、約款の投資制限等のモニタリングを通じ、法令等遵守状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

リスク管理担当部署

運用リスク全般の状況をモニタリング・管理するとともに、運用実績の分析および評価を行い、必要に応じて改善策等を提言します。また、事務・情報資産・その他のリスクの統括的管理を行っています。

内部監査担当部署

委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

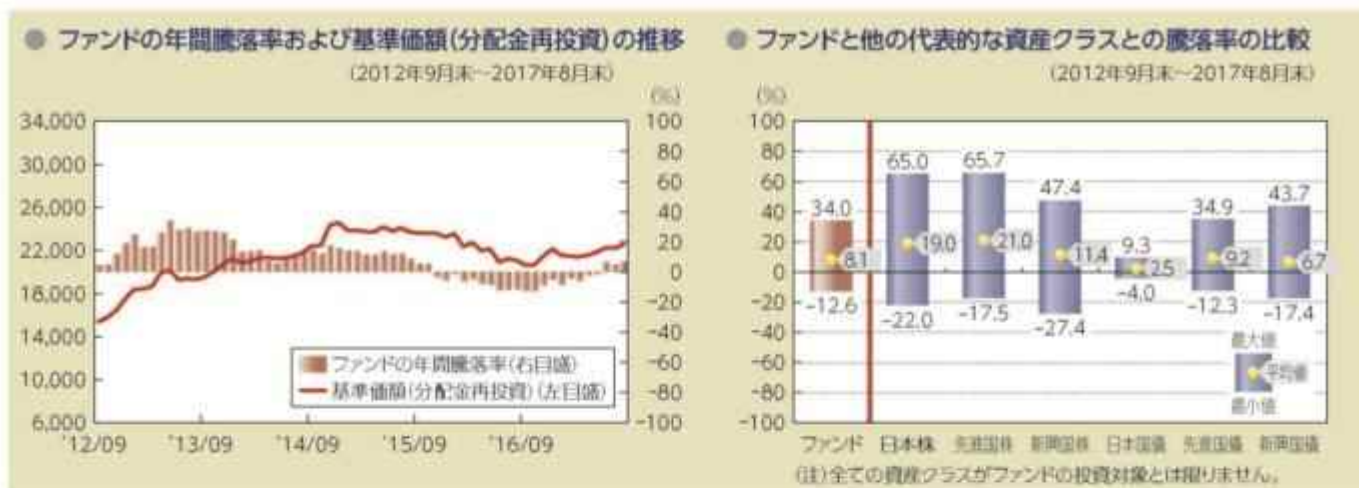
<流動性リスクに対する管理体制>

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であるトレーディング担当部署およびリスク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、この結果はリスク管理に関する会議体等に報告されます。

* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■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。

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。

申込みには分配金受取コース（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。

申込手数料の対価として提供する役務の内容は、ファンド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です。

(2)【換金（解約）手数料】

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（解約）手数料の対価として提供する役務の内容は、商品の換金に関する事務手続等です。

(3)【信託報酬等】

- 信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年1.08%（税抜1%）の率を乗じて得た額とします。

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。

- 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信託財産中から支弁します。
- 信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.475%	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
販売会社	0.475%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等
受託会社	0.05%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

(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、受託会社の立替えた立替金の利息、借入を行う場合の借入金の利息および借入れに関する品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- 信託財産（投資している投資信託を含みます。）の組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等（消費税等相当額を含みます。）、先物取引・オプション取引等に要する費用および外貨建資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担するものとします。

売買条件等により異なるため、あらかじめ金額または上限額等を記載することはできません。

- (注) 手数料等については、保有金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等を記載することはできません。なお、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。

（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29年8月末現在のもので、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】

【三菱UFJ 外国債券オープン】

（1）【投資状況】

平成29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	3,852,130,157	99.99
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		390,720	0.01
純資産総額		3,852,520,877	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29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(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
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		1,444,205,810	2.6387	3,810,825,871		99.99
					2.6673	3,852,130,157		

（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29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。

	純資産総額	基準価額 (1万口当たりの純資産価額)
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)
第17計算期間末日 (平成29年 8月10日)	3,830,277,051 (分配付) 3,788,003,577 (分配落)	13,591 (分配付) 13,441 (分配落)
平成28年 8月末日	4,041,988,749	12,846
9月末日	3,980,853,352	12,594
10月末日	3,984,682,589	12,603
11月末日	4,133,174,648	13,098
12月末日	4,174,471,287	13,495
平成29年 1月末日	4,039,616,050	13,162
2月末日	3,983,471,949	13,082
3月末日	3,958,429,400	13,072
4月末日	3,983,397,738	13,141
5月末日	4,024,819,030	13,326
6月末日	3,872,680,723	13,568
7月末日	3,834,230,473	13,549
8月末日	3,852,520,877	13,577

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
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
第17計算期間	150円

【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第17計算期間	7.30

（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
第17計算期間	343,217,420	625,760,386	2,818,231,648

<参考>

「三菱UFJ 外国債券マザーファンド」

（１）投資状況

平成29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	22,018,967,671	42.43
	フランス	5,285,108,068	10.18
	イタリア	5,071,010,074	9.77
	ドイツ	3,725,688,606	7.18
	イギリス	3,502,164,143	6.75
	スペイン	2,937,300,703	5.66
	ベルギー	1,303,631,911	2.51
	オランダ	1,120,080,446	2.16
	オーストラリア	1,115,431,300	2.15
	カナダ	1,082,320,426	2.09
	オーストリア	792,534,747	1.53
	メキシコ	450,152,105	0.87
	アイルランド	428,521,455	0.83
	フィンランド	327,169,341	0.63
	デンマーク	324,014,651	0.62
	ポーランド	322,378,058	0.62
	南アフリカ	273,790,291	0.53
	スウェーデン	247,847,538	0.48
	マレーシア	218,563,912	0.42
	シンガポール	198,173,331	0.38
ノルウェー	153,476,315	0.30	
スイス	88,361,005	0.17	
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		909,021,077	1.74
純資産総額		51,895,707,174	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29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 下段：評価額		利率（％）	投資 比率 （％）
					単価（円）	金額（円）	償還期限 （年/月/日）	
アメリカ	1.75 T-NOTE 220515	国債証券		3,250,000.00	11,013.53 11,066.1543	357,939,783 359,650,016	1.750000 2022/05/15	0.69
アメリカ	2.25 T-NOTE 251115	国債証券		3,020,000.00	11,096.20 11,195.5528	335,105,486 338,105,693	2.250000 2025/11/15	0.65
アメリカ	2.5 T-BOND 450215	国債証券		2,640,000.00	10,168.61 10,528.7195	268,451,488 277,958,195	2.500000 2045/02/15	0.54
アメリカ	1.5 T-NOTE 200415	国債証券		2,400,000.00	11,062.27 11,071.7616	265,494,537 265,722,278	1.500000 2020/04/15	0.51
アメリカ	2.375 T-NOTE 270515	国債証券		2,350,000.00	11,172.10 11,262.8400	262,544,529 264,676,740	2.375000 2027/05/15	0.51
フランス	3.5 O.A.T 260425	国債証券		1,600,000.00	16,474.21 16,541.6819	263,587,375 264,666,911	3.500000 2026/04/25	0.51
アメリカ	1.375 T-NOTE 200531	国債証券		2,300,000.00	10,990.32 11,033.3734	252,777,439 253,767,588	1.375000 2020/05/31	0.49
アメリカ	2.125 T-NOTE 250515	国債証券		2,150,000.00	11,017.70 11,114.4631	236,880,713 238,960,956	2.125000 2025/05/15	0.46
フランス	3.75 O.A.T 210425	国債証券		1,550,000.00	15,263.02 15,157.9494	236,576,831 234,948,215	3.750000 2021/04/25	0.45
アメリカ	2 T-NOTE 230215	国債証券		2,100,000.00	11,093.89 11,154.1453	232,971,845 234,237,051	2.000000 2023/02/15	0.45
アメリカ	1.625 T-NOTE 200315	国債証券		2,100,000.00	11,105.40 11,107.9931	233,213,509 233,267,857	1.625000 2020/03/15	0.45
アメリカ	3.125 T-BOND 440815	国債証券		1,950,000.00	11,531.12 11,905.5189	224,856,958 232,157,618	3.125000 2044/08/15	0.45
フランス	4.5 O.A.T 410425	国債証券		1,090,000.00	20,592.79 21,043.2948	224,461,504 229,371,913	4.500000 2041/04/25	0.44
イタリア	5 ITALY GOVT 340801	国債証券		1,290,000.00	17,175.33 17,202.1776	221,561,780 221,908,092	5.000000 2034/08/01	0.43
アメリカ	1.5 T-NOTE 200715	国債証券		2,000,000.00	11,042.66 11,062.2724	220,853,250 221,245,447	1.500000 2020/07/15	0.43
アメリカ	2.75 T-NOTE 231115	国債証券		1,900,000.00	11,545.79 11,610.4904	219,370,033 220,599,318	2.750000 2023/11/15	0.43
フランス	4.25 O.A.T 231025	国債証券		1,300,000.00	16,635.52 16,577.4064	216,261,817 215,506,283	4.250000 2023/10/25	0.42
イギリス	4.25 GILT 461207	国債証券		950,000.00	22,384.51 22,553.4276	212,652,854 214,257,562	4.250000 2046/12/07	0.41
アメリカ	2.125 T-NOTE 211231	国債証券		1,900,000.00	11,218.67 11,253.3507	213,154,768 213,813,664	2.125000 2021/12/31	0.41
イギリス	3.5 GILT 680722	国債証券		880,000.00	24,118.62 24,075.9230	212,243,919 211,868,123	3.500000 2068/07/22	0.41
アメリカ	1.375 T-NOTE 190228	国債証券		1,900,000.00	11,062.31 11,052.7831	210,184,062 210,002,879	1.375000 2019/02/28	0.40
アメリカ	2 T-NOTE 250215	国債証券		1,900,000.00	10,934.16 11,031.6481	207,749,191 209,601,314	2.000000 2025/02/15	0.40
アメリカ	1.375 T-NOTE 201031	国債証券		1,900,000.00	10,972.98 11,004.9057	208,486,762 209,093,209	1.375000 2020/10/31	0.40
アメリカ	1.625 T-NOTE 260515	国債証券		1,950,000.00	10,505.35 10,624.4743	204,854,496 207,177,249	1.625000 2026/05/15	0.40
アメリカ	3.75 T-NOTE 181115	国債証券		1,800,000.00	11,452.19 11,368.5153	206,139,474 204,633,276	3.750000 2018/11/15	0.39
アメリカ	1.625 T-NOTE 190630	国債証券		1,800,000.00	11,116.18 11,103.2485	200,091,391 199,858,474	1.625000 2019/06/30	0.39
アメリカ	3 T-BOND 450515	国債証券		1,700,000.00	11,241.27 11,616.5290	191,101,650 197,480,993	3.000000 2045/05/15	0.38
アメリカ	2.125 T-NOTE 210815	国債証券		1,700,000.00	11,239.54 11,260.2520	191,072,320 191,424,284	2.125000 2021/08/15	0.37
フランス	4.75 O.A.T 350425	国債証券		930,000.00	20,244.74 20,486.6758	188,276,152 190,526,085	4.750000 2035/04/25	0.37
アメリカ	1.875 T-NOTE 220331	国債証券		1,700,000.00	11,090.30 11,128.2656	188,535,248 189,180,515	1.875000 2022/03/31	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29年8月31日現在

種類 / 業種別	投資比率（％）
国債証券	98.25
合計	98.25

（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。

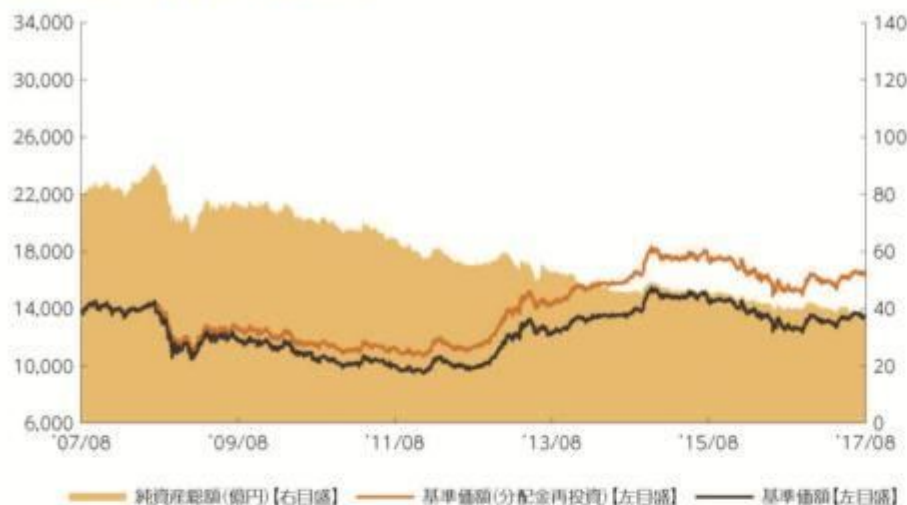
参考情報



運用実績

2017年8月31日現在

■基準価額・純資産の推移 2007年8月31日～2017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	13,577円
純資産総額	38.5億円

■分配の推移

2017年 8月	150円
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
設定来累計	6,450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	42.7%	1 1.75 T-NOTE 220515	国債	アメリカ	0.7%
ユーロ	41.0%	2 2.25 T-NOTE 251115	国債	アメリカ	0.7%
イギリスポンド	6.8%	3 2.5 T-BOND 450215	国債	アメリカ	0.5%
オーストラリアドル	2.2%	4 1.5 T-NOTE 200415	国債	アメリカ	0.5%
カナダドル	2.1%	5 2.375 T-NOTE 270515	国債	アメリカ	0.5%
メキシコペソ	0.9%	6 3.5 O.A.T 260425	国債	フランス	0.5%
円	0.7%	7 1.375 T-NOTE 200531	国債	アメリカ	0.5%
ポーランドズロチ	0.6%	8 2.125 T-NOTE 250515	国債	アメリカ	0.5%
その他	3.0%	9 3.75 O.A.T 210425	国債	フランス	0.5%
合計	100.0%	10 2 T-NOTE 230215	国債	アメリカ	0.5%

•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
- 2017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。

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。

申込単位

販売会社が定める単位

申込価額

取得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：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（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

申込みには分配金受取コース（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。

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）があります。申込みコースの取扱いは販売会社により異なる場合があります。

申込受付時間

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。

取得申込みの受付の中止および取消し

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。

申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

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。

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。

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から信託財産留保額を差引いた価額

信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.3%をかけた額

解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の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：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

解約代金は、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

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。

解約請求受付の中止および取消し

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。

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

換金（解約）手続等の詳細に関し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

基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

「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または一部償却原価法により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。

す。

（資産の評価方法）

・株式 / 上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券

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、金融商品取引所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。

・転換社債 / 転換社債型新株予約権付社債

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、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（外国で取引されているものについては、原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、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。

・公社債等

原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）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。

残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法による評価を適用することができます。

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・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。

・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。

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

基準価額の照会方法

基準価額は、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：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <http://www.am.mufg.jp/>

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限（平成12年8月18日設定）

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】

毎年８月１１日から翌年８月１０日まで

ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合、各計算期間終了日は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。なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

（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10億口を下回るようになった場合
- ・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「投資信託受益権の取扱に関する契約」の契約期間は、契約締結日から1年とします。ただし双方から契約満了日の3ヵ月前までに別段の意思表示のないときは、さらに1年間延長するものとし、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、ファンドの任意償還等があった場合は、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。

信託事務の再信託

受託会社は、ファンドに係る信託事務の処理の一部について再信託受託会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、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】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

分配金受取コース(一般コース)

収益分配金は、税金を差引いた後、毎計算期間の終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日以内)から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

分配金再投資コース(累積投資コース)

収益分配金は、税金を差引いた後、「累積投資契約」に基づいて、決算日の基準価額により自動的に無手数料で全額再投資されます。

(2) 償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(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営業日以内)から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、償還金について支払開始日から10年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(3) 換金(解約)請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金(解約)請求する権利を有します。

くわしくは「第2 管理及び運営 2 換金(解約)手続等」を参照してください。

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28年8月11日から平成29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16期 [平成28年 8月10日現在]	第17期 [平成29年 8月10日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	24,380,051	21,983,131
親投資信託受益証券	3,926,570,021	3,787,050,387
未収入金	49,711,900	51,689,400
流動資産合計	4,000,661,972	3,860,722,918
資産合計	4,000,661,972	3,860,722,918
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	46,511,619	42,273,474
未払解約金	4,408,553	9,320,132
未払受託者報酬	1,114,214	1,056,291
未払委託者報酬	21,170,018	20,069,422
未払利息	35	22
流動負債合計	73,204,439	72,719,341
負債合計	73,204,439	72,719,341
純資産の部		
元本等		
元本	3,100,774,614	2,818,231,648
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	826,682,919	969,771,929
(分配準備積立金)	664,709,972	577,814,807
元本等合計	3,927,457,533	3,788,003,577
純資産合計	3,927,457,533	3,788,003,577
負債純資産合計	4,000,661,972	3,860,722,918

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期		第17期	
	自	平成27年 8月11日 至 平成28年 8月10日	自	平成28年 8月11日 至 平成29年 8月10日
営業収益				
受取利息		4,403		133
有価証券売買等損益		611,049,022		323,805,266
営業収益合計		611,044,619		323,805,399
営業費用				
支払利息		2,897		6,266
受託者報酬		2,331,977		2,158,013
委託者報酬		44,307,409		41,002,057
その他費用		10		-
営業費用合計		46,642,293		43,166,336
営業利益又は営業損失（ ）		657,686,912		280,639,063
経常利益又は経常損失（ ）		657,686,912		280,639,063
当期純利益又は当期純損失（ ）		657,686,912		280,639,063
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（ ）		27,291,341		33,033,583
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,521,691,253		826,682,919
剰余金増加額又は欠損金減少額		167,981,112		103,962,406
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		167,981,112		103,962,406
剰余金減少額又は欠損金増加額		186,082,256		166,205,402
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		186,082,256		166,205,402
分配金		46,511,619		42,273,474
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		826,682,919		969,771,929

（ 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 16 期 [平成28年8月10日現在]	第 17 期 [平成29年8月10日現在]
1 期首元本額	3,076,354,297円	3,100,774,614円
期中追加設定元本額	405,636,981円	343,217,420円
期中一部解約元本額	381,216,664円	625,760,386円
2 受益権の総数	3,100,774,614口	2,818,231,648口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2666円 (12,666円)	1.3441円 (13,441円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

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

第 17 期（自 平成28年8月11日 至 平成29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	78,396,274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	800,787,484円
分配準備積立金額	D	541,692,007円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,420,875,765円
当ファンドの期末残存口数	F	2,818,231,648口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	5,041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	42,273,474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 16 期 (自 平成27年 8月11日 至 平成28年 8月10日)	第 17 期 (自 平成28年 8月11日 至 平成29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 16 期 [平成28年8月10日現在]	第 17 期 [平成29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ぬ。	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、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つた場合、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 16 期 [平成28年8月10日現在]	第 17 期 [平成29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	581,009,130	291,742,077
合計	581,009,130	291,742,077

(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	1,435,032,356	3,787,050,387	
	親投資信託受益証券 小計	1,435,032,356	3,787,050,387	
合計		1,435,032,356	3,787,050,387	

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>

当ファンドの主要投資対象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28年8月10日現在]	[平成29年8月10日現在]
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	171,660,926	36,822,625
コール・ローン	87,174,758	111,981,362
国債証券	64,360,343,343	51,021,227,258
派生商品評価勘定	563,057	1,495
未収入金	558,851,435	292,657,317
未収利息	519,320,066	417,815,656
前払費用	18,791,081	13,699,263
流動資産合計	65,716,704,666	51,894,204,976
資産合計	65,716,704,666	51,894,204,976
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	19,904	308,738
未払解約金	177,174,932	211,576,260
未払利息	127	115
流動負債合計	177,194,963	211,885,113
負債合計	177,194,963	211,885,113
純資産の部		
元本等		
元本	26,923,291,281	19,584,141,622
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	38,616,218,422	32,098,178,241
元本等合計	65,539,509,703	51,682,319,863
純資産合計	65,539,509,703	51,682,319,863
負債純資産合計	65,716,704,666	51,894,204,976

（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28年8月10日現在]	[平成29年8月10日現在]
1 期首	平成27年8月11日	平成28年8月11日
期首元本額	41,768,999,351円	26,923,291,281円
期首からの追加設定元本額	2,816,690,479円	1,886,451,975円
期首からの一部解約元本額	17,662,398,549円	9,225,601,634円
元本の内訳*		
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）	147,365,251円	152,201,919円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）	269,356,811円	291,476,861円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）	163,969,938円	180,258,902円
三菱UFJ 外国債券オープン	1,613,018,125円	1,435,032,356円
三菱UFJ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	1,143,837,723円	1,271,709,213円
三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	2,719,265,272円	3,095,294,006円
三菱UFJ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	1,600,583,180円	1,881,007,242円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	651,074,288円	590,798,792円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）	86,321,058円	82,453,866円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	144,218,353円	182,945,625円
三菱UFJ 外国債券オープン（確定拠出年金）	2,086,324,637円	2,074,324,521円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）	467,618,044円	440,932,671円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド（年1回決算型）	1,320,107,061円	1,320,160,787円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA（適格機関投資家限定）	13,626,210,034円	5,721,457,260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）	52,302円	5,034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）	376,083円	227,494円

三菱UFJ 外国債券ファンドVA2(適格機関投資家限定)	54,695,872円	43,152,941円
MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)	828,897,249円	820,702,132円
(合計)	26,923,291,281円	19,584,141,622円
2 受益権の総数	26,923,291,281口	19,584,141,622口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.4343円 (24,343円)	2.6390円 (26,390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27年8月11日 至平成28年8月10日)	(自平成28年8月11日 至平成29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28年8月10日現在]	[平成29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 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	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28年8月10日現在]	[平成29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	1,809,351,115	33,341,918
合計	1,809,351,115	33,341,918

(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28年8月10日現在]		
		契約額等(円)		評価損益 (円)
		うち1年超	時価 (円)	
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	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

区 分	種 類	[平成29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	73,716,625		73,812,200	95,575
	カナダドル	3,466,500		3,469,900	3,400
	オーストラリアドル	2,595,450		2,608,200	12,750
	イギリスポンド	12,865,275		12,902,100	36,825
	シンガポールドル	806,005		808,300	2,295
	スウェーデンクローネ	940,835		942,900	2,065
	ノルウェークローネ	552,300		554,000	1,700
	デンマーククローネ	1,388,040		1,392,800	4,760
	メキシコペソ	1,226,720		1,226,000	720
	ポーランドズロチ	1,211,232		1,213,600	2,368
	ユーロ	71,078,775		71,225,000	146,225
	合 計	169,847,757		170,155,000	307,243

(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ではありません。

(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 種類	銘 柄	券面総額	評 価 額	備考
アメリカドル				
国債証券	0.75 T-NOTE 180930	1,700,000.00	1,690,238.28	
	0.75 T-NOTE 190215	700,000.00	694,339.84	
	0.75 T-NOTE 190715	700,000.00	692,207.03	
	0.875 T-NOTE 181015	400,000.00	398,171.87	
	0.875 T-NOTE 190415	1,100,000.00	1,091,964.84	
	0.875 T-NOTE 190731	300,000.00	297,363.28	
	0.875 T-NOTE 190915	900,000.00	891,105.46	
	1 T-NOTE 180815	700,000.00	698,277.34	
	1 T-NOTE 181130	1,400,000.00	1,394,695.31	
	1 T-NOTE 190831	300,000.00	297,984.37	
	1 T-NOTE 190930	700,000.00	694,914.06	
	1 T-NOTE 191115	1,250,000.00	1,239,599.60	
	1 T-NOTE 191130	900,000.00	892,441.40	
	1.125 T-NOTE 191231	800,000.00	795,250.00	
	1.125 T-NOTE 200430	350,000.00	347,156.25	
	1.125 T-NOTE 210228	700,000.00	688,351.56	
	1.125 T-NOTE 210630	1,700,000.00	1,665,734.37	
	1.125 T-NOTE 210731	1,700,000.00	1,664,140.62	
	1.125 T-NOTE 210930	1,300,000.00	1,270,140.62	
	1.25 T-NOTE 181031	300,000.00	299,941.40	
	1.25 T-NOTE 181115	1,500,000.00	1,499,589.84	
	1.25 T-NOTE 181130	500,000.00	499,824.21	

1.25 T-NOTE 181215	1,300,000.00	1,299,238.28	
1.25 T-NOTE 190131	1,200,000.00	1,199,296.87	
1.25 T-NOTE 190430	450,000.00	449,419.92	
1.25 T-NOTE 191031	700,000.00	698,304.68	
1.25 T-NOTE 200131	1,100,000.00	1,095,789.06	
1.25 T-NOTE 200229	100,000.00	99,597.65	
1.25 T-NOTE 210331	900,000.00	888,257.81	
1.25 T-NOTE 211031	1,300,000.00	1,275,726.56	
1.25 T-NOTE 230731	300,000.00	288,398.43	
1.375 T-NOTE 180731	500,000.00	500,625.00	
1.375 T-NOTE 180930	300,000.00	300,375.00	
1.375 T-NOTE 181130	800,000.00	800,968.74	
1.375 T-NOTE 181231	1,400,000.00	1,401,804.68	
1.375 T-NOTE 190228	1,900,000.00	1,902,746.09	
1.375 T-NOTE 200115	800,000.00	799,593.74	
1.375 T-NOTE 200131	1,000,000.00	999,453.12	
1.375 T-NOTE 200229	1,100,000.00	1,098,796.87	
1.375 T-NOTE 200331	100,000.00	99,867.18	
1.375 T-NOTE 200430	1,050,000.00	1,048,113.28	
1.375 T-NOTE 200531	2,300,000.00	2,295,148.43	
1.375 T-NOTE 200831	900,000.00	896,554.68	
1.375 T-NOTE 201031	1,900,000.00	1,890,203.12	
1.375 T-NOTE 210131	950,000.00	943,097.65	
1.375 T-NOTE 230630	1,550,000.00	1,502,410.15	
1.375 T-NOTE 230831	850,000.00	822,308.59	
1.375 T-NOTE 230930	950,000.00	918,085.93	
1.5 T-NOTE 180831	800,000.00	802,062.50	
1.5 T-NOTE 181231	1,300,000.00	1,303,554.68	
1.5 T-NOTE 190131	1,650,000.00	1,655,027.34	
1.5 T-NOTE 190228	1,200,000.00	1,203,468.75	
1.5 T-NOTE 190331	400,000.00	401,281.25	
1.5 T-NOTE 190531	750,000.00	752,343.75	
1.5 T-NOTE 191031	1,600,000.00	1,604,750.00	
1.5 T-NOTE 191130	500,000.00	501,289.06	
1.5 T-NOTE 200415	2,400,000.00	2,403,843.74	
1.5 T-NOTE 200515	1,000,000.00	1,001,445.31	
1.5 T-NOTE 200531	550,000.00	550,601.56	
1.5 T-NOTE 200715	2,000,000.00	2,001,015.62	
1.5 T-NOTE 220131	200,000.00	197,875.00	
1.5 T-NOTE 230331	800,000.00	782,937.50	
1.5 T-NOTE 260815	1,600,000.00	1,507,374.99	
1.625 T-NOTE 190331	1,200,000.00	1,206,187.50	
1.625 T-NOTE 190430	1,100,000.00	1,105,757.81	
1.625 T-NOTE 190630	1,800,000.00	1,809,843.75	
1.625 T-NOTE 190731	650,000.00	653,605.46	
1.625 T-NOTE 190831	1,600,000.00	1,609,062.49	
1.625 T-NOTE 191231	1,000,000.00	1,005,546.87	
1.625 T-NOTE 200315	2,100,000.00	2,110,910.15	
1.625 T-NOTE 200731	250,000.00	250,996.09	
1.625 T-NOTE 201130	1,150,000.00	1,152,515.62	
1.625 T-NOTE 220815	550,000.00	545,359.37	
1.625 T-NOTE 221115	1,300,000.00	1,285,527.34	
1.625 T-NOTE 230430	1,050,000.00	1,033,757.81	
1.625 T-NOTE 231031	1,200,000.00	1,176,468.75	
1.625 T-NOTE 260215	1,750,000.00	1,674,941.40	
1.625 T-NOTE 260515	2,050,000.00	1,956,789.06	
1.75 T-NOTE 181031	1,100,000.00	1,106,488.28	
1.75 T-NOTE 190930	500,000.00	504,140.62	
1.75 T-NOTE 201031	1,000,000.00	1,006,796.87	
1.75 T-NOTE 201231	250,000.00	251,445.31	
1.75 T-NOTE 211130	1,550,000.00	1,552,058.59	
1.75 T-NOTE 220228	100,000.00	99,992.18	
1.75 T-NOTE 220331	950,000.00	949,035.15	
1.75 T-NOTE 220430	550,000.00	549,269.53	
1.75 T-NOTE 220515	3,250,000.00	3,247,460.93	
1.75 T-NOTE 220531	1,600,000.00	1,597,750.00	
1.75 T-NOTE 220930	900,000.00	896,625.00	
1.75 T-NOTE 230131	850,000.00	844,089.84	
1.75 T-NOTE 230515	1,200,000.00	1,189,218.75	
1.875 T-NOTE 211130	900,000.00	906,046.87	

1.875 T-NOTE 220331	1,700,000.00	1,707,835.93	
1.875 T-NOTE 220531	100,000.00	100,445.31	
1.875 T-NOTE 220831	1,000,000.00	1,003,046.87	
1.875 T-NOTE 221031	1,200,000.00	1,201,875.00	
2 T-NOTE 200731	250,000.00	253,769.53	
2 T-NOTE 200930	800,000.00	811,750.00	
2 T-NOTE 201130	600,000.00	608,578.12	
2 T-NOTE 210228	700,000.00	709,679.68	
2 T-NOTE 210531	600,000.00	607,828.12	
2 T-NOTE 210831	1,100,000.00	1,113,363.28	
2 T-NOTE 211031	1,100,000.00	1,112,890.62	
2 T-NOTE 211115	1,500,000.00	1,518,398.43	
2 T-NOTE 211231	450,000.00	454,992.18	
2 T-NOTE 220215	1,200,000.00	1,213,828.12	
2 T-NOTE 221130	1,200,000.00	1,208,812.50	
2 T-NOTE 230215	2,100,000.00	2,112,632.81	
2 T-NOTE 240531	600,000.00	598,640.62	
2 T-NOTE 250215	1,900,000.00	1,886,046.87	
2 T-NOTE 250815	1,400,000.00	1,385,015.62	
2 T-NOTE 261115	1,150,000.00	1,128,707.03	
2.125 T-NOTE 210131	100,000.00	101,828.12	
2.125 T-NOTE 210630	1,400,000.00	1,424,609.37	
2.125 T-NOTE 210815	1,700,000.00	1,729,484.37	
2.125 T-NOTE 210930	1,100,000.00	1,118,476.56	
2.125 T-NOTE 211231	1,900,000.00	1,931,468.75	
2.125 T-NOTE 221231	1,000,000.00	1,013,125.00	
2.125 T-NOTE 231130	900,000.00	908,367.18	
2.125 T-NOTE 240229	850,000.00	856,109.37	
2.125 T-NOTE 240331	550,000.00	553,566.40	
2.125 T-NOTE 250515	2,150,000.00	2,150,503.90	
2.25 T-BOND 460815	600,000.00	531,281.25	
2.25 T-NOTE 180731	800,000.00	807,750.00	
2.25 T-NOTE 210331	200,000.00	204,468.75	
2.25 T-NOTE 210430	900,000.00	920,039.06	
2.25 T-NOTE 210731	1,300,000.00	1,328,640.62	
2.25 T-NOTE 231231	800,000.00	812,750.00	
2.25 T-NOTE 240131	1,450,000.00	1,472,316.40	
2.25 T-NOTE 241115	700,000.00	708,093.75	
2.25 T-NOTE 251115	3,020,000.00	3,040,054.68	
2.25 T-NOTE 270215	900,000.00	901,335.93	
2.375 T-NOTE 201231	1,300,000.00	1,334,937.50	
2.375 T-NOTE 240815	1,030,000.00	1,051,887.50	
2.375 T-NOTE 270515	2,350,000.00	2,378,089.83	
2.5 T-BOND 450215	2,640,000.00	2,479,331.24	
2.5 T-BOND 460215	950,000.00	889,585.93	
2.5 T-BOND 460515	550,000.00	514,679.68	
2.5 T-NOTE 230815	1,650,000.00	1,703,367.18	
2.5 T-NOTE 240515	1,500,000.00	1,544,648.43	
2.625 T-NOTE 200815	1,200,000.00	1,239,890.62	
2.625 T-NOTE 201115	1,500,000.00	1,551,269.53	
2.75 T-BOND 420815	450,000.00	447,925.77	
2.75 T-BOND 421115	800,000.00	795,125.00	
2.75 T-NOTE 190215	1,000,000.00	1,021,679.68	
2.75 T-NOTE 231115	1,900,000.00	1,988,320.31	
2.75 T-NOTE 240215	1,300,000.00	1,359,718.75	
2.875 T-BOND 430515	1,450,000.00	1,472,203.12	
2.875 T-BOND 450815	1,250,000.00	1,264,453.12	
2.875 T-BOND 461115	950,000.00	960,167.96	
3 T-BOND 420515	200,000.00	208,328.12	
3 T-BOND 441115	1,500,000.00	1,556,718.75	
3 T-BOND 450515	1,700,000.00	1,762,421.87	
3 T-BOND 451115	1,200,000.00	1,243,125.00	
3 T-BOND 470215	590,000.00	611,203.12	
3 T-BOND 470515	470,000.00	487,294.52	
3.125 T-BOND 411115	350,000.00	372,777.34	
3.125 T-BOND 420215	100,000.00	106,507.80	
3.125 T-BOND 430215	800,000.00	849,875.00	
3.125 T-BOND 440815	1,950,000.00	2,071,875.00	
3.125 T-NOTE 190515	800,000.00	825,187.50	
3.125 T-NOTE 210515	750,000.00	790,957.03	

3.375 T-BOND 440515	1,510,000.00	1,676,925.78	
3.375 T-NOTE 191115	300,000.00	313,429.68	
3.5 T-BOND 390215	350,000.00	397,824.21	
3.5 T-NOTE 200515	800,000.00	844,781.24	
3.625 T-BOND 430815	1,150,000.00	1,329,328.12	
3.625 T-BOND 440215	1,050,000.00	1,216,031.25	
3.625 T-NOTE 190815	700,000.00	731,937.50	
3.625 T-NOTE 200215	1,050,000.00	1,107,873.04	
3.625 T-NOTE 210215	1,350,000.00	1,444,394.53	
3.75 T-BOND 410815	500,000.00	588,671.87	
3.75 T-BOND 431115	800,000.00	944,937.50	
3.75 T-NOTE 181115	1,800,000.00	1,855,054.68	
3.875 T-BOND 400815	500,000.00	598,750.00	
4 T-NOTE 180815	1,300,000.00	1,336,003.90	
4.25 T-BOND 390515	350,000.00	441,109.37	
4.25 T-BOND 401115	500,000.00	632,070.31	
4.375 T-BOND 380215	300,000.00	384,117.18	
4.375 T-BOND 391115	150,000.00	192,304.68	
4.375 T-BOND 400515	500,000.00	641,914.06	
4.375 T-BOND 410515	450,000.00	579,867.18	
4.5 T-BOND 360215	400,000.00	518,874.99	
4.5 T-BOND 380515	200,000.00	260,265.62	
4.5 T-BOND 390815	300,000.00	390,960.93	
4.625 T-BOND 400215	600,000.00	795,750.00	
4.75 T-BOND 410215	350,000.00	473,757.81	
5 T-BOND 370515	200,000.00	275,687.50	
5.25 T-BOND 281115	250,000.00	323,203.12	
5.25 T-BOND 290215	50,000.00	64,839.84	
5.375 T-BOND 310215	400,000.00	539,796.87	
5.5 T-BOND 280815	200,000.00	262,500.00	
6 T-BOND 260215	1,300,000.00	1,691,015.62	
6.125 T-BOND 271115	300,000.00	406,500.00	
6.25 T-BOND 230815	100,000.00	124,726.56	
6.25 T-BOND 300515	250,000.00	357,578.12	
6.5 T-BOND 261115	300,000.00	408,421.87	
8 T-BOND 211115	600,000.00	755,484.37	
8.125 T-BOND 190815	300,000.00	340,371.09	
8.75 T-BOND 200815	800,000.00	970,468.74	
8.875 T-BOND 190215	600,000.00	669,351.56	
国債証券 小計	195,860,000.00	200,187,010.49 (22,058,606,685)	
アメリカドル 小計	195,860,000.00	200,187,010.49 (22,058,606,685)	
カナダドル			
国債証券			
0.5 CAN GOVT 180801	500,000.00	496,930.00	
0.5 CAN GOVT 181101	400,000.00	396,740.00	
0.5 CAN GOVT 220301	200,000.00	191,120.00	
0.75 CAN GOVT 190801	550,000.00	544,802.50	
0.75 CAN GOVT 200901	500,000.00	491,100.00	
0.75 CAN GOVT 210301	400,000.00	391,180.00	
0.75 CAN GOVT 210901	650,000.00	632,287.50	
1 CAN GOVT 220901	350,000.00	340,483.50	
1 CAN GOVT 270601	300,000.00	276,015.00	
1.5 CAN GOVT 200301	600,000.00	603,408.00	
1.5 CAN GOVT 230601	450,000.00	446,976.00	
1.5 CAN GOVT 260601	400,000.00	388,984.00	
1.75 CAN GOVT 190301	600,000.00	605,226.00	
1.75 CAN GOVT 190901	300,000.00	303,126.00	
2.25 CAN GOVT 250601	400,000.00	413,800.00	
2.5 CAN GOVT 240601	400,000.00	420,468.00	
2.75 CAN GOVT 220601	450,000.00	475,551.00	
2.75 CAN GOVT 481201	310,000.00	338,396.00	
2.75 CANADA GOVER 641201	150,000.00	169,569.00	
3.25 CAN GOVT 210601	350,000.00	373,740.50	
3.5 CAN GOVT 200601	300,000.00	318,021.00	
3.5 CAN GOVT 451201	450,000.00	555,120.00	
3.75 CAN GOVT 190601	1,000,000.00	1,044,870.00	
4 CAN GOVT 410601	420,000.00	545,806.80	
5 CAN GOVT 370601	370,000.00	529,573.60	
5.75 CAN GOVT 290601	300,000.00	416,835.00	

	5.75 CAN GOVT 330601	350,000.00	517,023.50	
	8 CAN GOVT 270601	150,000.00	231,613.50	
	国債証券 小計	11,600,000.00	12,458,766.40 (1,080,922,572)	
カナダドル 小計		11,600,000.00	12,458,766.40 (1,080,922,572)	
オーストラリアドル				
国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	700,000.00	694,960.70	
	2 AUST GOVT 211221	350,000.00	348,218.15	
	2.25 AUST GOVT 280521	150,000.00	143,948.40	
	2.75 AUST GOVT 191021	700,000.00	714,285.60	
	2.75 AUST GOVT 240421	770,000.00	787,527.51	
	2.75 AUST GOVT 271121	700,000.00	706,851.60	
	2.75 AUST GOVT 281121	300,000.00	301,257.00	
	2.75 AUST GOVT 350621	200,000.00	190,612.00	
	3 AUST GOVT 470321	240,000.00	218,789.28	
	3.25 AUST GOVT 250421	800,000.00	843,452.80	
	3.25 AUST GOVT 290421	830,000.00	872,653.70	
	3.25 AUST GOVT 390621	190,000.00	189,328.16	
	3.75 AUST GOVT 370421	280,000.00	303,960.72	
	4.25 AUST GOVT 260421	850,000.00	962,338.55	
	4.5 AUST GOVT 200415	820,000.00	875,987.96	
	4.5 AUST GOVT 330421	370,000.00	442,256.93	
	4.75 AUST GOVT 270421	800,000.00	947,392.00	
	5.25 AUST GOVT 190315	950,000.00	1,003,168.65	
	5.5 AUST GOVT 230421	550,000.00	644,592.85	
	5.75 AUST GOVT 210515	850,000.00	964,036.00	
	5.75 AUST GOVT 220715	650,000.00	758,162.60	
	国債証券 小計	12,050,000.00	12,913,781.16 (1,122,982,409)	
オーストラリアドル 小計		12,050,000.00	12,913,781.16 (1,122,982,409)	
イギリスポンド				
国債証券	0.5 GILT 220722	800,000.00	800,567.20	
	1.25 GILT 270722	50,000.00	50,486.50	
	1.5 GILT 210122	350,000.00	364,415.45	
	1.5 GILT 260722	400,000.00	417,412.00	
	1.75 GILT 190722	900,000.00	927,000.00	
	1.75 GILT 220907	650,000.00	691,431.00	
	1.75 GILT 370907	100,000.00	100,399.90	
	1.75 GILT 570722	60,000.00	62,203.80	
	2 GILT 200722	850,000.00	894,155.80	
	2 GILT 250907	900,000.00	980,460.00	
	2.25 GILT 230907	670,000.00	735,439.57	
	2.5 GILT 650722	350,000.00	456,429.40	
	2.75 GILT 240907	350,000.00	398,482.00	
	3.25 GILT 440122	750,000.00	981,375.00	
	3.5 GILT 450122	400,000.00	549,024.00	
	3.5 GILT 680722	880,000.00	1,465,722.72	
	3.75 GILT 200907	750,000.00	831,238.50	
	3.75 GILT 210907	450,000.00	512,811.00	
	3.75 GILT 520722	500,000.00	773,600.00	
	4 GILT 220307	450,000.00	524,323.35	
	4 GILT 600122	80,000.00	138,717.60	
	4.25 GILT 271207	350,000.00	457,254.70	
	4.25 GILT 320607	490,000.00	671,204.94	
	4.25 GILT 360307	740,000.00	1,049,098.00	
	4.25 GILT 390907	370,000.00	540,501.18	
	4.25 GILT 401207	590,000.00	873,074.92	
	4.25 GILT 461207	950,000.00	1,490,759.95	
	4.25 GILT 491207	680,000.00	1,107,278.00	
	4.25 GILT 551207	330,000.00	575,923.92	
	4.5 GILT 190307	650,000.00	694,027.75	
	4.5 GILT 340907	450,000.00	646,533.00	
	4.5 GILT 421207	430,000.00	671,398.13	
	4.75 GILT 200307	500,000.00	558,982.50	
	4.75 GILT 301207	390,000.00	550,836.00	
	4.75 GILT 381207	480,000.00	741,836.16	
	5 GILT 250307	450,000.00	589,995.00	
	6 GILT 281207	350,000.00	529,791.15	
	8 GILT 210607	250,000.00	323,557.00	

国債証券 小計		19,140,000.00	24,727,747.09 (3,545,217,100)
イギリスポンド 小計		19,140,000.00	24,727,747.09 (3,545,217,100)
スイスフラン			
国債証券	2 SWISS GOVT 210428	120,000.00	132,132.60
	2.25 SWISS GOVT 200706	130,000.00	141,509.68
	3 SWISS GOVT 190512	110,000.00	117,463.28
	4 SWISS GOVT 230211	140,000.00	175,399.00
	4 SWISS GOVT 280408	160,000.00	230,237.12
国債証券 小計		660,000.00	796,741.68 (91,043,671)
スイスフラン 小計		660,000.00	796,741.68 (91,043,671)
シンガポールドル			
国債証券	1.625 SINGAPORGOV 191001	50,000.00	50,375.00
	2 SINGAPORGOV 200701	150,000.00	152,925.00
	2.125 SINGAPORGOV 260601	70,000.00	70,525.00
	2.25 SINGAPORGOV 210601	220,000.00	226,226.00
	2.25 SINGAPORGOV 360801	60,000.00	58,724.70
	2.5 SINGAPORGOV 190601	220,000.00	225,000.60
	2.75 SINGAPORGOV 230701	180,000.00	189,810.00
	2.75 SINGAPORGOV 420401	170,000.00	179,520.00
	2.75 SINGAPORGOV 460301	50,000.00	53,068.50
	2.875 SINGAPORGOV 290701	50,000.00	53,400.00
	2.875SINGAPORGOV 300901	150,000.00	159,462.75
	3 SINGAPORGOV 240901	250,000.00	268,125.00
	3.125SINGAPORGOV 220901	180,000.00	193,050.00
	3.25 SINGAPORGOV 200901	170,000.00	179,724.00
	3.375 SINGAPORGOV 330901	70,000.00	78,820.00
	3.5 SINGAPORGOV 270301	200,000.00	224,090.00
	4 SINGAPORGOV 180901	100,000.00	103,050.00
国債証券 小計		2,340,000.00	2,465,896.55 (199,367,736)
シンガポールドル 小計		2,340,000.00	2,465,896.55 (199,367,736)
マレーシアリンギット			
国債証券	3.418MALAYSIAGOV 220815	350,000.00	344,225.00
	3.48 MALAYSIAGOV 230315	250,000.00	245,788.00
	3.492 MALAYSIAGOV 200331	300,000.00	300,325.80
	3.502MALAYSIAGOV 270531	300,000.00	282,727.80
	3.62 MALAYSIAGOV 211130	200,000.00	199,833.20
	3.733 MALAYSIAGO 280615	100,000.00	94,789.70
	3.759 MALAYSIAGOV 190315	100,000.00	100,745.50
	3.795 MALAYSIAGOV 220930	400,000.00	400,458.40
	3.8 MALAYSIAGOV 230817	300,000.00	298,814.40
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	300,000.00	281,397.00
	3.889 MALAYSIAGO 200731	450,000.00	455,684.85
	3.892 MALAYSIAGOV 270315	450,000.00	438,380.10
	3.899 MALAYSIAGOV 271116	150,000.00	148,728.15
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	500,000.00	496,737.00
	4.048 MALAYSIA 210930	480,000.00	486,078.24
	4.127 MALAYSIA 320415	200,000.00	192,587.00
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	400,000.00	409,105.20
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	400,000.00	405,656.80
	4.232MALAYSIAGOV 310630	200,000.00	195,939.60
	4.254 MALAYSIAGOV 350531	200,000.00	194,128.40
	4.378MALAYSIAGOV 191129	900,000.00	919,530.00
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	300,000.00	305,904.90
	4.498 MALAYSIAGOV 300415	500,000.00	505,419.00
4.736 MALAYSIAGOV 460315	100,000.00	99,622.80	
4.935 MALAYSIAGOV 430930	300,000.00	306,707.70	
5.734MALAYSIAGOV 190730	300,000.00	313,464.00	
国債証券 小計		8,430,000.00	8,422,778.54 (216,381,180)
マレーシアリンギット 小計		8,430,000.00	8,422,778.54 (216,381,180)
スウェーデンクローネ			
国債証券	0.75 SWD GOVT 280512	1,050,000.00	1,050,541.80
	1 SWD GOVT 261112	1,750,000.00	1,813,327.25
	1.5 SWD GOVT 231113	2,200,000.00	2,381,038.00

	2.5 SWD GOVT 250512	1,550,000.00	1,799,990.20
	3.5 SWD GOVT 220601	2,850,000.00	3,340,627.50
	3.5 SWD GOVT 390330	1,260,000.00	1,725,403.68
	4.25 SWD GOVT 190312	2,600,000.00	2,806,809.20
	5 SWD GOVT 201201	2,700,000.00	3,184,434.00
	国債証券 小計	15,960,000.00	18,102,171.63 (243,836,251)
	スウェーデンクローネ 小計	15,960,000.00	18,102,171.63 (243,836,251)
	ノルウェークローネ		
国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	1,000,000.00	1,002,900.00
	1.75 NORWE GOVT 250313	1,350,000.00	1,386,531.00
	1.75 NORWE GOVT 270217	650,000.00	660,653.50
	2 NORWE GOVT 230524	1,650,000.00	1,726,787.70
	3 NORWE GOVT 240314	1,350,000.00	1,498,027.50
	3.75 NORWE GOVT 210525	2,250,000.00	2,489,865.75
	4.5 NORWE GOVT 190522	2,100,000.00	2,245,301.10
	国債証券 小計	10,350,000.00	11,010,066.55 (152,599,522)
	ノルウェークローネ 小計	10,350,000.00	11,010,066.55 (152,599,522)
	デンマーククローネ		
国債証券	0.25 DMK GOVT 181115	1,000,000.00	1,010,824.00
	0.5 DMK GOVT 271115	700,000.00	695,994.60
	1.5 DMK GOVT 231115	1,300,000.00	1,422,902.00
	1.75 DMK GOVT 251115	2,700,000.00	3,026,100.60
	3 DMK GOVT 211115	2,750,000.00	3,140,934.50
	4 DMK GOVT 191115	2,900,000.00	3,201,266.50
	4.5 DMK GOVT 391115	3,600,000.00	6,074,424.00
	国債証券 小計	14,950,000.00	18,572,446.20 (323,346,288)
	デンマーククローネ 小計	14,950,000.00	18,572,446.20 (323,346,288)
	メキシコペソ		
国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	8,290,000.00	9,815,360.00
	10 MEXICAN BONOS 361120	2,050,000.00	2,659,998.00
	5 MEXICAN BONOS 191211	6,900,000.00	6,647,115.00
	5.75 MEXICAN BONO 260305	3,850,000.00	3,573,916.50
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	9,500,000.00	9,420,580.00
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	4,300,000.00	4,252,614.00
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	2,900,000.00	3,031,950.00
	7.75 MEXICAN BONO 310529	3,900,000.00	4,147,377.00
	7.75 MEXICAN BONO 341123	2,700,000.00	2,879,010.00
	7.75 MEXICAN BONO 421113	5,500,000.00	5,842,320.00
	8 MEXICAN BONOS 200611	5,500,000.00	5,679,300.00
	8 MEXICAN BONOS 231207	2,700,000.00	2,867,940.00
	8 MEXICAN BONOS 471107	1,150,000.00	1,255,276.75
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	5,500,000.00	5,613,245.00
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	2,200,000.00	2,477,563.00
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	2,600,000.00	2,976,311.00
	国債証券 小計	69,540,000.00	73,139,876.25 (449,078,840)
	メキシコペソ 小計	69,540,000.00	73,139,876.25 (449,078,840)
	ポーランドズロチ		
国債証券	1.5 POLAND 200425	750,000.00	740,475.00
	1.75 POLAND 210725	600,000.00	585,720.00
	2 POLAND 210425	950,000.00	938,600.00
	2.25 POLAND 220425	500,000.00	491,350.00
	2.5 POLAND 260725	1,050,000.00	987,367.50
	2.5 POLAND 270725	480,000.00	445,032.00
	3.25 POLAND 190725	800,000.00	822,400.00
	3.25 POLAND 250725	850,000.00	854,037.50
	4 POLAND 231025	800,000.00	849,800.00
	5.25 POLAND 201025	750,000.00	821,250.00
	5.5 POLAND 191025	600,000.00	646,584.00
	5.75 POLAND 211025	700,000.00	791,210.00
	5.75 POLAND 220923	600,000.00	686,640.00
	5.75 POLAND 290425	370,000.00	458,333.80
	POLAND 181025	450,000.00	441,405.00

国債証券 小計		10,250,000.00	10,560,204.80 (320,502,215)
ポーランドズロチ 小計		10,250,000.00	10,560,204.80 (320,502,215)
南アフリカランド			
国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	5,200,000.00	5,839,600.00
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	2,650,000.00	1,903,351.90
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	2,700,000.00	1,898,370.00
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	1,500,000.00	1,465,425.00
	7 SOUTH AFRICA 310228	3,550,000.00	2,952,282.95
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	1,700,000.00	1,697,960.00
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	1,950,000.00	1,936,837.50
	8 SOUTH AFRICA 181221	300,000.00	303,390.00
	8 SOUTH AFRICA 300131	2,700,000.00	2,480,884.20
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	2,050,000.00	1,875,311.30
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	3,400,000.00	3,047,168.40
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	2,350,000.00	2,108,619.75
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	4,100,000.00	3,678,725.00
	8.875 SOUTH AFRIC 350228	800,000.00	751,371.20
	9 SOUTH AFRICA 400131	1,050,000.00	971,931.45
国債証券 小計		36,000,000.00	32,911,228.65 (270,530,299)
南アフリカランド 小計		36,000,000.00	32,911,228.65 (270,530,299)
ユーロ			
国債証券	0 BUND 260815	700,000.00	682,677.10
	0 FINNISH GOVT 230915	50,000.00	49,849.05
	0 NETH GOVT 220115	300,000.00	304,116.90
	0 O.A.T 190225	200,000.00	201,872.40
	0 O.A.T 200525	850,000.00	861,327.10
	0 O.A.T 210525	300,000.00	303,725.40
	0 O.A.T 220525	300,000.00	301,990.80
	0 OBL 200417	600,000.00	610,453.20
	0 OBL 210409	700,000.00	713,314.70
	0 OBL 211008	100,000.00	101,827.20
	0 OBL 220408	600,000.00	610,093.80
	0 SCHATS 180914	250,000.00	251,945.50
	0.1 ITALY GOVT 190415	100,000.00	100,570.00
	0.25 BUND 270215	650,000.00	643,986.20
	0.25 NETH GOVT 200115	450,000.00	459,446.40
	0.25 NETH GOVT 250715	400,000.00	400,171.20
	0.25 O.A.T 201125	600,000.00	613,121.40
	0.25 O.A.T 261125	620,000.00	598,314.88
	0.25 OBL 191011	500,000.00	510,362.00
	0.25 OBL 201016	300,000.00	308,063.10
	0.25 SPAIN GOVT 190131	50,000.00	50,445.65
	0.3 ITALY GOVT 181015	100,000.00	100,736.30
	0.35 ITALY GOVT 211101	100,000.00	99,318.00
	0.375 FINNISH GOV 200915	250,000.00	256,580.25
	0.4 SPAIN GOVT 220430	200,000.00	201,604.00
	0.45 ITALY GOVT 210601	500,000.00	501,406.00
	0.5 AUSTRIA GOVT 270420	150,000.00	148,733.40
	0.5 BUND 250215	650,000.00	671,857.55
	0.5 BUND 260215	750,000.00	768,942.00
	0.5 FINNISH GOVT 260415	100,000.00	100,640.50
	0.5 NETH GOVT 260715	610,000.00	615,625.42
	0.5 O.A.T 191125	700,000.00	716,885.40
	0.5 O.A.T 250525	550,000.00	555,203.55
	0.5 O.A.T 260525	400,000.00	398,065.60
	0.5 OBL 190412	700,000.00	714,419.30
	0.65 ITALY GOVT 201101	200,000.00	202,802.20
	0.65 ITALY GOVT 231015	300,000.00	290,319.90
	0.7 ITALY GOVT 200501	400,000.00	406,316.00
	0.75 AUSTRIA GOVT 261020	350,000.00	357,809.20
	0.75 FINNISH GOVT 310415	150,000.00	147,377.70
	0.75 NETH GOVT 270715	150,000.00	152,983.50
	0.75 SPAIN GOVT 210730	700,000.00	720,538.00
	0.8 BEL GOVT 250622	700,000.00	721,595.00
	0.8 BEL GOVT 270622	400,000.00	402,959.20
	0.8 IRISH GOVT 220315	150,000.00	156,297.45
	0.875 FINNISH GOV 250915	200,000.00	208,508.80

0.95 ITALY GOVT 230315	350,000.00	348,898.55	
1 BEL GOVT 310622	230,000.00	227,490.70	
1 BUND 240815	400,000.00	428,793.20	
1 BUND 250815	800,000.00	856,029.60	
1 IRISH GOVT 260515	100,000.00	102,360.80	
1 O.A.T 181125	1,050,000.00	1,071,612.15	
1 O.A.T 190525	700,000.00	719,849.20	
1 O.A.T 251125	750,000.00	783,007.50	
1 O.A.T 270525	800,000.00	821,524.80	
1 OBL 181012	700,000.00	714,252.00	
1 OBL 190222	900,000.00	924,091.20	
1.05 ITALY GOVT 191201	400,000.00	409,816.80	
1.125 FINNISH GOV 180915	100,000.00	101,991.20	
1.15 SPAIN GOVT 200730	550,000.00	571,446.70	
1.2 AUSTRIA GOVT 251020	200,000.00	214,303.40	
1.2 ITALY GOVT 220401	350,000.00	357,779.80	
1.25 ITALY GOVT 261201	300,000.00	284,691.30	
1.25 NETH GOVT 190115	400,000.00	411,038.00	
1.25 O.A.T 360525	500,000.00	489,750.00	
1.3 SPAIN GOVT 261031	300,000.00	300,249.60	
1.35 ITALY GOVT 220415	450,000.00	462,883.50	
1.4 SPAIN GOVT 200131	700,000.00	728,281.40	
1.45 BEL GOVT 370622	50,000.00	50,369.70	
1.45 ITALY GOVT 220915	100,000.00	102,929.00	
1.45 SPAIN GOVT 271031	300,000.00	297,867.30	
1.5 AUSTRIA GOVT 470220	50,000.00	50,341.85	
1.5 BUND 220904	450,000.00	491,581.80	
1.5 BUND 230215	650,000.00	712,665.20	
1.5 BUND 230515	450,000.00	494,342.55	
1.5 BUND 240515	550,000.00	608,253.80	
1.5 FINNISH GOVT 230415	250,000.00	272,139.00	
1.5 ITALY GOVT 190801	400,000.00	412,792.00	
1.5 ITALY GOVT 250601	500,000.00	495,450.00	
1.5 O.A.T 310525	920,000.00	969,234.72	
1.5 SPAIN GOVT 270430	450,000.00	453,486.15	
1.6 BEL GOVT 470622	180,000.00	174,988.44	
1.6 ITALY GOVT 260601	500,000.00	491,450.50	
1.6 SPAIN GOVT 250430	700,000.00	731,625.30	
1.625 FINNISH GOV 220915	200,000.00	218,202.40	
1.65 AUSTRIA GOVT 241021	300,000.00	331,882.80	
1.65 ITALY GOVT 320301	480,000.00	437,751.84	
1.7 IRISH GOVT 370515	140,000.00	142,673.02	
1.75 AUSTRIA GOVT 231020	430,000.00	477,042.86	
1.75 BUND 220704	750,000.00	827,400.00	
1.75 BUND 240215	680,000.00	762,353.44	
1.75 NETH GOVT 230715	300,000.00	332,827.50	
1.75 O.A.T 230525	1,150,000.00	1,266,582.40	
1.75 O.A.T 241125	820,000.00	907,293.10	
1.75 O.A.T 390625	250,000.00	263,201.50	
1.85 ITALY GOVT 240515	450,000.00	463,275.00	
1.95 AUSTRIA GOVT 190618	400,000.00	418,899.60	
1.95 SPAIN GOVT 260430	1,000,000.00	1,060,741.00	
1.95 SPAIN GOVT 300730	550,000.00	557,829.80	
2 BUND 220104	600,000.00	664,340.40	
2 BUND 230815	450,000.00	508,878.00	
2 FINNISH GOVT 240415	100,000.00	112,513.80	
2 IRISH GOVT 450218	200,000.00	209,408.40	
2 ITALY GOVT 251201	550,000.00	561,852.50	
2 NETH GOVT 240715	450,000.00	509,787.00	
2 O.A.T 480525	200,000.00	211,753.40	
2.15 BEL GOVT 660622	70,000.00	74,496.10	
2.15 ITALY GOVT 211215	600,000.00	640,310.40	
2.15 SPAIN GOVT 251031	500,000.00	539,649.00	
2.2 ITALY GOVT 270601	500,000.00	509,050.00	
2.25 BEL GOVT 230622	500,000.00	566,452.00	
2.25 BEL GOVT 570622	100,000.00	110,596.40	
2.25 BUND 200904	550,000.00	598,774.00	
2.25 BUND 210904	450,000.00	500,391.00	
2.25 ITALY GOVT 360901	300,000.00	280,933.50	
2.25 NETH GOVT 220715	400,000.00	449,581.20	

2.25 O.A.T 221025	650,000.00	729,352.00	
2.25 O.A.T 240525	850,000.00	969,717.40	
2.4 AUSTRIA GOVT 340523	150,000.00	181,931.25	
2.4 IRISH GOVT 300515	250,000.00	286,879.00	
2.45 ITALY GOVT 330901	30,000.00	29,647.26	
2.5 BUND 210104	750,000.00	828,901.50	
2.5 BUND 440704	620,000.00	815,202.04	
2.5 BUND 460815	610,000.00	809,211.97	
2.5 ITALY GOVT 190501	650,000.00	680,200.95	
2.5 ITALY GOVT 241201	550,000.00	586,556.30	
2.5 NETH GOVT 330115	360,000.00	446,532.48	
2.5 O.A.T 201025	1,050,000.00	1,150,254.00	
2.5 O.A.T 300525	970,000.00	1,144,842.50	
2.6 BEL GOVT 240622	500,000.00	581,909.00	
2.625 FINNISH GOV 420704	130,000.00	171,649.40	
2.7 ITALY GOVT 470301	470,000.00	432,968.70	
2.75 FINNISH GOVT 280704	120,000.00	146,570.16	
2.75 NETH GOVT 470115	340,000.00	467,250.44	
2.75 O.A.T 271025	950,000.00	1,137,987.90	
2.75 SPAIN GOVT 190430	400,000.00	421,425.60	
2.75 SPAIN GOVT 241031	650,000.00	735,209.80	
2.8 ITALY GOVT 670301	190,000.00	163,690.13	
2.9 SPAIN GOVT 461031	350,000.00	363,883.80	
3 BEL GOVT 190928	300,000.00	322,952.10	
3 BEL GOVT 340622	100,000.00	127,561.80	
3 BUND 200704	600,000.00	663,867.60	
3 O.A.T 220425	1,250,000.00	1,438,250.00	
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	230,000.00	321,562.77	
3.25 BUND 200104	600,000.00	657,153.00	
3.25 BUND 210704	600,000.00	688,563.00	
3.25 BUND 420704	450,000.00	663,484.05	
3.25 ITALY GOVT 460901	430,000.00	442,663.50	
3.25 NETH GOVT 210715	450,000.00	515,559.15	
3.25 O.A.T 211025	1,300,000.00	1,494,308.40	
3.25 O.A.T 450525	660,000.00	893,772.00	
3.375 FINNISH GOV 200415	150,000.00	165,792.30	
3.4 AUSTRIA GOVT 221122	300,000.00	357,026.40	
3.4 IRISH GOVT 240318	250,000.00	300,851.75	
3.45 ITALY GOVT 480301	160,000.00	168,118.40	
3.45 SPAIN GOVT 660730	150,000.00	165,406.50	
3.5 AUSTRIA GOVT 210915	450,000.00	521,799.30	
3.5 BUND 190704	530,000.00	572,782.13	
3.5 FINNISH GOVT 210415	150,000.00	171,633.30	
3.5 ITALY GOVT 181201	1,050,000.00	1,101,854.25	
3.5 ITALY GOVT 300301	900,000.00	1,014,739.20	
3.5 NETH GOVT 200715	550,000.00	616,025.85	
3.5 O.A.T 200425	1,350,000.00	1,497,409.20	
3.5 O.A.T 260425	1,600,000.00	2,010,886.40	
3.65 AUSTRIA GOVT 220420	250,000.00	296,407.50	
3.75 BEL GOVT 200928	550,000.00	623,423.35	
3.75 BEL GOVT 450622	320,000.00	471,644.16	
3.75 BUND 190104	700,000.00	744,284.80	
3.75 ITALY GOVT 210301	1,050,000.00	1,178,661.75	
3.75 ITALY GOVT 210501	550,000.00	618,939.20	
3.75 ITALY GOVT 210801	800,000.00	903,652.00	
3.75 ITALY GOVT 240901	350,000.00	403,261.25	
3.75 NETH GOVT 230115	550,000.00	667,928.80	
3.75 NETH GOVT 420115	440,000.00	688,138.88	
3.75 O.A.T 191025	1,200,000.00	1,315,146.00	
3.75 O.A.T 210425	1,550,000.00	1,789,685.80	
3.75 SPAIN GOVT 181031	800,000.00	841,300.00	
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	110,000.00	187,168.96	
3.8 SPAIN GOVT 240430	600,000.00	720,246.60	
3.9 AUSTRIA GOVT 200715	400,000.00	451,704.40	
3.9 IRISH GOVT 230320	150,000.00	181,962.00	
4 BEL GOVT 190328	200,000.00	215,083.80	
4 BEL GOVT 220328	550,000.00	659,322.95	
4 BEL GOVT 320328	250,000.00	350,225.00	
4 BUND 370104	630,000.00	977,795.28	
4 FINNISH GOVT 250704	110,000.00	142,012.42	

4 ITALY GOVT 200901	600,000.00	670,053.60	
4 ITALY GOVT 370201	700,000.00	833,672.00	
4 NETH GOVT 190715	300,000.00	327,079.20	
4 NETH GOVT 370115	430,000.00	662,673.00	
4 O.A.T 381025	470,000.00	695,243.74	
4 O.A.T 550425	440,000.00	706,265.12	
4 O.A.T 600425	480,000.00	790,003.20	
4 SPAIN GOVT 200430	900,000.00	1,002,861.00	
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	380,000.00	582,578.00	
4.2 SPAIN GOVT 370131	650,000.00	846,946.10	
4.25 BEL GOVT 210928	350,000.00	416,966.20	
4.25 BEL GOVT 220928	400,000.00	491,184.00	
4.25 BEL GOVT 410328	580,000.00	900,315.44	
4.25 BUND 390704	360,000.00	592,538.76	
4.25 ITALY GOVT 190201	1,200,000.00	1,279,402.80	
4.25 ITALY GOVT 190901	450,000.00	490,213.35	
4.25 ITALY GOVT 200301	950,000.00	1,051,606.30	
4.25 O.A.T 181025	150,000.00	158,829.00	
4.25 O.A.T 190425	1,200,000.00	1,299,873.60	
4.25 O.A.T 231025	1,350,000.00	1,702,046.25	
4.3 SPAIN GOVT 191031	600,000.00	661,122.00	
4.35 AUSTRIA GOVT 190315	450,000.00	485,622.00	
4.375 FINNISH GOV 190704	200,000.00	219,108.00	
4.4 IRISH GOVT 190618	200,000.00	218,417.40	
4.4 SPAIN GOVT 231031	600,000.00	739,331.40	
4.5 BEL GOVT 260328	500,000.00	673,122.00	
4.5 IRISH GOVT 181018	220,000.00	233,114.86	
4.5 IRISH GOVT 200418	300,000.00	340,041.00	
4.5 ITALY GOVT 180801	700,000.00	733,096.70	
4.5 ITALY GOVT 190301	700,000.00	751,788.80	
4.5 ITALY GOVT 200201	700,000.00	776,965.00	
4.5 ITALY GOVT 230501	900,000.00	1,071,490.50	
4.5 ITALY GOVT 240301	650,000.00	778,915.80	
4.5 ITALY GOVT 260301	650,000.00	791,830.00	
4.5 O.A.T 410425	1,130,000.00	1,808,971.80	
4.6 SPAIN GOVT 190730	600,000.00	658,127.40	
4.65 SPAIN GOVT 250730	650,000.00	828,998.30	
4.7 SPAIN GOVT 410730	580,000.00	811,541.22	
4.75 BUND 280704	200,000.00	291,617.80	
4.75 BUND 340704	550,000.00	893,201.10	
4.75 BUND 400704	470,000.00	831,884.96	
4.75 ITALY GOVT 210901	750,000.00	878,703.00	
4.75 ITALY GOVT 230801	900,000.00	1,090,369.80	
4.75 ITALY GOVT 280901	600,000.00	751,947.60	
4.75 ITALY GOVT 440901	430,000.00	559,430.00	
4.75 O.A.T 350425	940,000.00	1,464,638.44	
4.8 SPAIN GOVT 240131	500,000.00	631,096.00	
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	300,000.00	415,571.70	
4.85 SPAIN GOVT 201031	500,000.00	579,942.00	
4.9 SPAIN GOVT 400730	480,000.00	686,678.40	
5 BEL GOVT 350328	640,000.00	1,028,246.40	
5 IRISH GOVT 201018	250,000.00	293,380.25	
5 ITALY GOVT 220301	650,000.00	775,626.80	
5 ITALY GOVT 250301	700,000.00	870,870.00	
5 ITALY GOVT 340801	1,310,000.00	1,738,869.11	
5 ITALY GOVT 390801	600,000.00	804,555.60	
5 ITALY GOVT 400901	640,000.00	852,320.00	
5.15 SPAIN GOVT 281031	500,000.00	681,446.00	
5.15 SPAIN GOVT 441031	200,000.00	297,406.00	
5.25 ITALY GOVT 291101	850,000.00	1,120,517.60	
5.4 IRISH GOVT 250313	450,000.00	614,421.00	
5.4 SPAIN GOVT 230131	600,000.00	761,896.20	
5.5 BEL GOVT 280328	550,000.00	822,120.20	
5.5 BUND 310104	570,000.00	926,930.58	
5.5 ITALY GOVT 220901	500,000.00	615,543.00	
5.5 ITALY GOVT 221101	570,000.00	703,473.48	
5.5 NETH GOVT 280115	390,000.00	587,620.80	
5.5 O.A.T 290425	860,000.00	1,305,632.22	
5.5 SPAIN GOVT 210430	750,000.00	904,173.75	
5.625 BUND 280104	500,000.00	767,192.50	

5.75 ITALY GOVT 330201	200,000.00	282,710.00	
5.75 O.A.T 321025	760,000.00	1,255,623.36	
5.75 SPAIN GOVT 320730	580,000.00	868,051.20	
5.85 SPAIN GOVT 220131	750,000.00	940,920.75	
5.9 IRISH GOVT 191018	180,000.00	205,209.18	
5.9 SPAIN GOVT 260730	350,000.00	487,957.75	
6 ITALY GOVT 310501	820,000.00	1,166,596.78	
6 O.A.T 251025	650,000.00	946,985.00	
6 SPAIN GOVT 290131	600,000.00	874,736.40	
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	200,000.00	312,082.40	
6.25 BUND 240104	200,000.00	281,500.20	
6.25 BUND 300104	250,000.00	420,745.00	
6.5 BUND 270704	300,000.00	480,118.80	
6.5 ITALY GOVT 271101	650,000.00	918,060.00	
7.25 ITALY GOVT 261101	550,000.00	803,385.00	
8.5 O.A.T 191025	300,000.00	360,314.10	
8.5 O.A.T 230425	350,000.00	521,886.05	
9 ITALY GOVT 231101	300,000.00	439,917.60	
国債証券 小計	137,650,000.00	161,751,447.80 (20,946,812,490)	
ユーロ 小計	137,650,000.00	161,751,447.80 (20,946,812,490)	
合 計		51,021,227,258 (51,021,227,258)	

(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 201銘柄	100.00%	43.23%
カナダドル	国債証券 28銘柄	100.00%	2.12%
オーストラリアドル	国債証券 21銘柄	100.00%	2.20%
イギリスポンド	国債証券 38銘柄	100.00%	6.95%
スイスフラン	国債証券 5銘柄	100.00%	0.18%
シンガポールドル	国債証券 17銘柄	100.00%	0.39%
マレーシアリングット	国債証券 26銘柄	100.00%	0.42%
スウェーデンクローネ	国債証券 8銘柄	100.00%	0.48%
ノルウェークローネ	国債証券 7銘柄	100.00%	0.30%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.00%	0.63%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.00%	0.88%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.00%	0.63%
南アフリカランド	国債証券 15銘柄	100.00%	0.53%
ユーロ	国債証券 274銘柄	100.00%	41.06%

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】

【三菱UFJ 外国債券オープン】

【純資産額計算書】

平成29年8月31日現在
(単位：円)

資産総額	3,859,465,615
負債総額	6,944,738
純資産総額(-)	3,852,520,877
発行済口数	2,837,520,221 口
1口当たり純資産価額(/)	1.3577 (1万口当たり 13,577)

(参考)

三菱UFJ 外国債券マザーファンド

純資産額計算書

平成29年8月31日現在
(単位：円)

資産総額	52,034,827,637
負債総額	139,120,463
純資産総額(-)	51,895,707,174
発行済口数	19,455,976,359 口
1口当たり純資産価額(/)	2.6673 (1万口当たり 26,673)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等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、委託会社は、この信託の受益権を取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。なお、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、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

該当事項はありません。

(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）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。

第三部【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】

（1）資本金の額等

平成29年8月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

（2）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

業務執行の基本方針を決定し、取締役の職務の執行を監督する機関として、取締役会を設置します。取締役の選任は、総株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席する株主総会にてその議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。また、取締役会で決定した基本方針に基づき、経営管理全般に関する執行方針その他重要な事項を協議・決定する機関として、経営会議を設置します。

・投資運用の意思決定機構

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。

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用(投資運用業)等を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。平成29年8月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。(親投資信託を除きます。)

商品分類	本数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	832	11,020,040
追加型公社債投資信託	16	1,379,844
単位型株式投資信託	52	358,881
単位型公社債投資信託	1	6,409
合計	901	12,765,173

なお、純資産総額の金額については、百万円未満の端数を四捨五入して記載しておりますので、表中の個々の数字の合計と合計欄の数字とは一致しないことがあります。

3【委託会社等の経理状況】

(1) 財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱UFJ国際投信株式会社(以下「当社」という。)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)」「(以下「財務諸表等規則」という。)第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令(平成19年内閣府令第52号)」に基づき作成しております。

財務諸表に掲載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第32期事業年度(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)		第32期 (平成29年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	2	80,707,781	2	69,212,680
有価証券		2,728,127		36,210
前払費用		402,267		337,699
未収入金		14,286		35,896
未収委託者報酬		11,275,577		10,076,022
未収収益	2	564,923	2	659,405
繰延税金資産		491,700		446,374
金銭の信託	2	30,000	2	30,000
その他		438,012		113,754
流動資産合計		96,652,678		80,948,042

固定資産				
有形固定資産				
建物	1	846,844	1	806,798
器具備品	1	768,584	1	759,446
土地		1,356,000		1,356,000
有形固定資産合計		2,971,428		2,922,245
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		1,813,951		1,844,549
ソフトウェア仮勘定		341,815		608,066
その他		71		10
無形固定資産合計		2,171,661		2,468,448
投資その他の資産				
投資有価証券		24,223,272		24,327,081
関係会社株式		320,136		320,136
長期差入保証金		686,446		654,402
前払年金費用		499,178		463,105
繰延税金資産		786,810		711,230
その他		51,090		50,235
貸倒引当金		23,600		23,600
投資その他の資産合計		26,543,335		26,502,592
固定資産合計		31,686,425		31,893,286
資産合計		128,339,103		112,841,328

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)		第32期 (平成29年3月31日現在)	
(負債の部)				
流動負債				
預り金		199,091		166,493
未払金				
未払収益分配金		101,046		108,024
未払償還金		821,178		547,707
未払手数料	2	4,866,423	2	4,225,009
その他未払金	2	2,521,849	2	2,355,815
未払費用	2	3,419,978	2	3,061,479
未払消費税等		370,110		351,670
未払法人税等		947,540		756,668
賞与引当金		882,523		843,729
役員賞与引当金				100,680
その他		670,983		711,633
流動負債合計		14,800,725		13,228,909
固定負債				
退職給付引当金		508,142		590,154

役員退職慰労引当金	166,789	166,458
時効後支払損引当金	257,105	253,070
固定負債合計	932,038	1,009,684
負債合計	15,732,763	14,238,594
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金	3,572,096	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712	44,732,712
利益剰余金		
利益準備金	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金	57,079,782	43,034,713
利益剰余金合計	64,420,372	50,375,303
株主資本合計	111,153,216	97,108,147

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
評価・換算差額等		
その他有価証券 評価差額金	1,446,576	1,494,586
繰延ヘッジ損益	6,546	
評価・換算差額等合計	1,453,123	1,494,586
純資産合計	112,606,339	98,602,734
負債純資産合計	128,339,103	112,841,328

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	82,096,942	81,709,776
投資顧問料	2,226,322	2,396,020
その他営業収益	35,063	25,763
営業収益合計	84,358,328	84,131,560
営業費用		
支払手数料	2 34,821,751	2 33,975,255
広告宣伝費	742,632	731,771
公告費		482

調査費		
調査費	1,642,352	1,713,892
委託調査費	14,530,744	13,961,993
事務委託費	751,410	984,749
営業雑経費		
通信費	122,574	158,915
印刷費	704,639	699,940
協会費	51,201	51,995
諸会費	7,730	9,887
事務機器関連費	1,674,745	1,611,608
その他営業雑経費	30,382	11,925
営業費用合計	55,080,164	53,912,419
一般管理費		
給料		
役員報酬	280,681	331,997
給料・手当	5,948,603	6,496,165
賞与引当金繰入	882,523	843,729
役員賞与引当金繰入		100,680
福利厚生費	1,091,897	1,196,210
交際費	17,062	14,843
旅費交通費	212,578	233,159
租税公課	264,376	422,030
不動産賃借料	795,415	706,571
退職給付費用	341,073	441,736
役員退職慰労引当金繰入	34,369	48,393
固定資産減価償却費	1,068,796	1,030,040
諸経費	426,547	474,521
一般管理費合計	11,363,925	12,340,079
営業利益	17,914,238	17,879,061

(単位：千円)

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	235,697	243,048
有価証券利息	523	0
受取利息	2 15,142	2 4,601
投資有価証券償還益	9,315	260,190
収益分配金等時効完成分	71,619	278,148
その他	17,393	4,383
営業外収益合計	349,691	790,372
営業外費用		
投資有価証券償還損	152,298	11,552
時効後支払損引当金繰入	98,891	
事務過誤費	421	218
その他	5,862	4,357

営業外費用合計		257,473		16,128
経常利益		18,006,455		18,653,304
特別利益				
投資有価証券売却益		424,605		259,137
ゴルフ会員権売却益		1,300		
特別利益合計		425,905		259,137
特別損失				
投資有価証券売却損		52,623		42,248
デリバティブ解約損				126,228
有価証券評価損		67,284		
投資有価証券評価損		18,539		157,482
固定資産除却損	1	1,305	1	13,540
減損損失	3	42,073	3	48,575
合併関連費用		829,181		
特別損失合計		1,011,007		388,075
税引前当期純利益		17,421,353		18,524,367
法人税、住民税及び事業税	2	5,796,941	2	5,658,953
法人税等調整額		1,035,591		103,169
法人税等合計		4,761,350		5,762,122
当期純利益		12,660,003		12,762,244

(3) 【株主資本等変動計算書】

第31期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,131	222,096		222,096	342,589	6,998,000	48,527,422	55,868,012	58,090,240
当期変動額									
剰余金の配当							4,107,643	4,107,643	4,107,643
当期純利益							12,660,003	12,660,003	12,660,003
合併による増加		3,350,000	41,160,616	44,510,616					44,510,616
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計		3,350,000	41,160,616	44,510,616			8,552,359	8,552,359	53,062,976
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	57,079,782	64,420,372	111,153,216

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	2,300,727		2,300,727	60,390,967

当期変動額				
剰余金の配当				4,107,643
当期純利益				12,660,003
合併による増加	903,495	148,745	754,749	45,265,365
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	1,757,645	155,292	1,602,353	1,602,353
当期変動額合計	854,150	6,546	847,604	52,215,371
当期末残高	1,446,576	6,546	1,453,123	112,606,339

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	57,079,782	64,420,372	111,153,216
当期変動額									
剰余金の配当							26,807,312	26,807,312	26,807,312
当期純利益							12,762,244	12,762,244	12,762,244
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)									
当期変動額合計							14,045,068	14,045,068	14,045,068
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	43,034,713	50,375,303	97,108,147

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,446,576	6,546	1,453,123	112,606,339
当期変動額				
剰余金の配当				26,807,312
当期純利益				12,762,244
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	48,009	6,546	41,462	41,462
当期変動額合計	48,009	6,546	41,462	14,003,605
当期末残高	1,494,586		1,494,586	98,602,734

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

- (2) その他有価証券
時価のあるもの
決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。
時価のないもの
移動平均法による原価法を採用しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法
時価法を採用しております。
3. 固定資産の減価償却の方法
- (1) 有形固定資産
定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。
なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。
- | | |
|------|--------|
| 建物 | 5年～50年 |
| 器具備品 | 2年～20年 |
- (2) 無形固定資産
定額法を採用しております。
なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準
外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準
- (1) 貸倒引当金
貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。
- (2) 賞与引当金
従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。
- (3) 役員賞与引当金
役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。
- (4) 退職給付引当金
従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。
- 退職給付見込額の期間帰属方法
退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。
数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法
過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理することとしております。
数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（主として10年）による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。
- (追加情報)
当社では退職給付制度を統合するため、平成28年9月21日に確定給付企業年金制度、退職一時金制度、確定拠出年金制度を改定し、同年10月1日より退職一時金制度、確定拠出年金制度を柱とした新制度に移行しております。この移行に伴い「退職給付制度間の移行等に関する会計処理」（企業会計基準委員会 平成14年1月31日 企業会計基準適用指針第1号）及び「退職給付制度間の移行等の会計処理に関する実務上の取扱い」（企業会計基準委員会 平成19年2月7日 実務対応報告第2号）を適用しております。
なお、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であ

ります。

(5) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

(6) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段... 株式指数先物

ヘッジ対象... 投資有価証券

(3) ヘッジ方針

株価変動リスクの低減のため、対象資産の範囲内でヘッジを行っております。

(4) ヘッジの有効性評価の方法

ヘッジ開始から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして判断しております。

7. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

税抜方式を採用しており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

[会計方針の変更]

（平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱いの適用）

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

なお、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。

[追加情報]

（繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針の適用）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当事業年度から適用しております。

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
建物	467,206千円	539,649千円
器具備品	897,207千円	1,029,950千円

2. 関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
預金	43,128,360千円	47,798,472千円
未収収益	52,753千円	46,963千円
金銭の信託	30,000千円	30,000千円
未払手数料	2,612,168千円	1,993,055千円
その他未払金	2,296,632千円	2,071,256千円

未払費用

442,340千円

456,748千円

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

	第31期	第32期
	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
建物	254千円	2,392千円
器具備品	1,051千円	7,791千円
ソフトウェア	-	3,356千円
計	1,305千円	13,540千円

2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第31期	第32期
	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
支払手数料	15,120,269千円	13,862,465千円
受取利息	12,609千円	4,375千円
法人税、住民税及び事業税	3,980,844千円	4,204,969千円

3. 減損損失

当社は、以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

第31期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

場所	用途	種類	減損損失
静岡県裾野市	遊休資産（不動産）	土地	35,031千円
東京都千代田区（本社）	遊休資産（美術品）	器具備品	7,041千円

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグルーピングとしております。遊休資産については個別資産ごとにグルーピングを行っております。

前事業年度において、事業の用に供していない遊休資産のうち、時価が著しく下落した資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、当資産グループの回収可能価額は正味売却価額により測定しており、土地、美術品については外部鑑定評価額により評価しております。

第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

場所	用途	種類	減損損失
東京都千代田区（本社）	自社利用ソフトウェア（遊休資産）	ソフトウェア 仮勘定	48,575千円

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグルーピングとしております。遊休資産については個別資産ごとにグルーピングを行っております。

当事業年度において、将来の使用見込みがなくなった自社利用ソフトウェアについて、帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、回収可能価額として使用価値を用いておりますが、将来の使用見込みがないため、使用価値は零としております。

(株主資本等変動計算書関係)

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式（注）	124,098	87,483	-	211,581
合計	124,098	87,483	-	211,581

（注）普通株式の発行済株式総数の増加は、平成27年7月1日に、国際投信投資顧問株式会社との間で吸収合併方式による経営統合を行ない、同社の普通株式1株に対して当社の普通株式10.0497株を交付したことによる増加であります。

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成27年6月30日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	4,107,643千円
1株当たり配当額	33,100円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27年6月30日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成28年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	26,807,312千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	126,700円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月29日

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	211,581	-	-	211,581
合計	211,581	-	-	211,581

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成28年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	26,807,312千円
1株当たり配当額	126,700円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月29日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成29年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	26,595,731千円
配当の原資	利益剰余金

1株当たり配当額	125,700円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月29日

（リース取引関係）

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
1年内	678,116千円	678,116千円
1年超	2,651,815千円	1,973,699千円
合計	3,329,932千円	2,651,815千円

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、譲渡性預金または投資信託に限定しており、金融機関からの資金調達はありません。デリバティブ取引は、後述するリスクを回避するために利用しており、投機的な取引は行わない方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。なお、一部の投資信託の価格変動リスクに対して、デリバティブ取引を利用してヘッジしております。

(4) 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変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。また、注記事項「デリバティブ取引関係」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

第31期(平成28年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	80,707,781	80,707,781	-
(2) 有価証券	2,728,127	2,728,127	-
(3) 未収委託者報酬	11,275,577	11,275,577	-
(4) 投資有価証券	24,054,542	24,054,542	-
資産計	118,766,029	118,766,029	-
(1) 未払手数料	4,866,423	4,866,423	-
負債計	4,866,423	4,866,423	-
デリバティブ取引()	(3,459)	(3,459)	-

デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務

となる項目については()で表示しております。

第32期(平成29年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	69,212,680	69,212,680	-
(2) 有価証券	36,210	36,210	-
(3) 未収委託者報酬	10,076,022	10,076,022	-
(4) 投資有価証券	24,189,921	24,189,921	-
資産計	103,514,834	103,514,834	-
(1) 未払手数料	4,225,009	4,225,009	-
負債計	4,225,009	4,225,009	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項
資 産

(1) 現金及び預金、(3) 未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 有価証券、(4) 投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

負 債

(1) 未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
非上場株式	168,730	137,160
子会社株式	160,600	160,600
関連会社株式	159,536	159,536

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第31期(平成28年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	80,707,781	-	-	-
未収委託者報酬	11,275,577	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	2,728,127	9,234,321	9,756,778	5,050

合計	94,711,487	9,234,321	9,756,778	5,050
----	------------	-----------	-----------	-------

第32期(平成29年3月31日現在)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	69,212,680	-	-	-
未収委託者報酬	10,076,022	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	36,210	10,703,761	8,324,138	45,606
合計	79,324,912	10,703,761	8,324,138	45,606

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式(当事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円、前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

2. その他有価証券

第31期(平成28年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	113,875	30,541	83,333
	債券	-	-	-
	その他	19,085,937	16,697,402	2,388,535
	小計	19,199,812	16,727,944	2,471,868
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	7,582,857	7,969,134	386,277
	小計	7,582,857	7,969,134	386,277
合計		26,782,669	24,697,079	2,085,590

第32期(平成29年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	17,778,798	15,302,336	2,476,461
	小計	17,778,798	15,302,336	2,476,461
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	6,447,333	6,769,569	322,236
	小計	6,447,333	6,769,569	322,236
合計		24,226,131	22,071,906	2,154,225

3. 売却したその他有価証券

第31期(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

種類	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他	5,649,814	424,605	52,623
合計	5,649,814	424,605	52,623

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
株式	122,688	82,146	21,570
債券	-	-	-
その他	3,439,009	176,991	20,678
合計	3,561,698	259,137	42,248

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について85,823千円（その他有価証券のその他85,823千円）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について157,482千円（その他有価証券のその他157,482千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

（デリバティブ取引関係）

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

重要な取引はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（単位：千円）

ヘッジ会計の方法	取引の種類	主なヘッジ対象	契約額等	契約額等のうち1年超	時価
原則的処理方法	株式指数先物取引 売建	投資有価証券	945,410	-	3,459
合計			945,410	-	3,459

（注）時価の算定方法

大阪取引所が定める清算指数によっております。

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

重要な取引はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度（積立型制度）及び退職一時金制度（非積立型制度）を設けております。また確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	第31期 （自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）	第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
退職給付債務の期首残高	263,476 千円	2,997,931 千円

勤務費用	135,457	199,166
利息費用	19,818	22,711
数理計算上の差異の発生額	113,714	40,934
退職給付の支払額	159,115	183,403
過去勤務費用の発生額	-	653,618
合併による増加	2,624,579	-
退職給付債務の期末残高	2,997,931	3,649,089

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
年金資産の期首残高	196,439 千円	2,678,827 千円
期待運用収益	35,926	47,553
数理計算上の差異の発生額	111,449	7,066
事業主からの拠出額	210,960	107,823
退職給付の支払額	139,379	142,532
合併による増加	2,486,329	-
年金資産の期末残高	2,678,827	2,698,738

(3)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	2,422,447 千円	3,471,120 千円
年金資産	2,678,827	2,698,738
	256,380	772,381
非積立型制度の退職給付債務	575,484	177,969
未積立退職給付債務	319,103	950,350
未認識数理計算上の差異	310,139	207,810
未認識過去勤務費用	-	615,490
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	8,964	127,049
退職給付引当金	508,142	590,154
前払年金費用	499,178	463,105
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	8,964	127,049

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
勤務費用	135,457 千円	199,166 千円
利息費用	19,818	22,711
期待運用収益	35,926	47,553
数理計算上の差異の費用処理額	13,847	54,327
過去勤務費用の費用処理額	-	38,127

その他	65,395	28,533
確定給付制度に係る退職給付費用	198,592	295,314

（注）「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額等です。

(5)年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
債券	58.1 %	62.9 %
株式	35.5	33.3
その他	6.3	3.7
合計	100	100

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
割引率	0.077～0.71%	0.061～0.90%
長期期待運用収益率	1.5～1.8%	1.5～1.8%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度142,480千円、当事業年度146,421千円でありま

す。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別の内訳

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	475,116 千円	455,165 千円
投資有価証券評価損	238,391	242,551
ゴルフ会員権評価損	295	295
未払事業税	185,473	124,367
賞与引当金	272,346	260,374
役員賞与引当金	-	11,509
役員退職慰労引当金	51,071	50,969
退職給付引当金	155,593	180,726
減価償却超過額	29,059	19,277
委託者報酬	204,395	217,902
長期差入保証金	6,344	14,803
時効後支払損引当金	78,725	77,490
連結納税適用による時価評価	309,675	236,450
その他	69,525	68,614

繰延税金資産 小計	2,076,013	1,960,499
評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	2,076,013	1,960,499
繰延税金負債		
未収配当金	1,228	-
前払年金費用	152,848	141,802
連結納税適用による時価評価	1,516	1,447
その他有価証券評価差額金	639,013	659,638
繰延ヘッジ損益	2,889	-
その他	6	3
繰延税金負債 合計	797,502	802,893
繰延税金資産の純額	1,278,511	1,157,605

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
法定実効税率	33.06 %	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。
(調整)		
評価性引当額の減少	6.34	
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.59	
その他	0.02	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.33	

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）及び第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）及び第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	(株)三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,141,513百万円	銀行持株会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税 役員の兼任	連結納税に伴う支払	3,980,844千円	その他未払金	2,296,632千円
親会社	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279百万円	信託業、銀行業	被所有 直接 51.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 事務所の賃借	投資信託に係る事務代行手数料の支払 事務所賃借料	5,895,622千円 223,695千円	未払手数料	805,721千円
主要株主	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 取引銀行	投資信託に係る事務代行手数料の支払 コーラブル預金の預入	9,224,647千円 35,000,000千円	未払手数料 現金及び預金	1,806,446千円 35,000,000千円
							コーラブル預金に係る受取利息	9,263千円	未収収益	2,372千円

--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	(株)三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,141,513 百万円	銀行持株会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税 役員の兼任	連結納税に伴う支払	4,204,969 千円	その他未払金	2,071,256 千円
親会社	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 51.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	5,983,874 千円	未払手数料	716,117 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料	662,992 千円	未払費用	352,297 千円
主要株主	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	7,878,591 千円	未払手数料	1,276,937 千円

(注)取引条件及び取引条件の決定方針等

連結納税については、連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

事務所敷金及び賃借料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。

預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は1年であります。

上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第31期(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱い及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	6,398,782 千円	未払手数料	898,096 千円

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱い及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	6,532,238 千円	未払手数料	933,908 千円

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

	第31期 （自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）	第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
1株当たり純資産額	532,213.85円	466,028.30円
1株当たり当期純利益金額	66,691.34円	60,318.47円

（注）1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
当期純利益金額（千円）	12,660,003	12,762,244
普通株主に帰属しない金額（千円）	-	-
普通株式に係る当期純利益金額 (千円)	12,660,003	12,762,244
普通株式の期中平均株式数（株）	189,829	211,581

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。)

通常の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29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29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	48,323 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。
めぶき証券株式会社	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29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【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、また使用開始日、ファンドの形態、申込みに係る事項、ファンド専用サイトのアドレスなどを記載することがあります。
- (2) 投資信託説明書(交付目論見書)に、以下の趣旨の文言の全部または一部および有価証券届出書の主要内容を記載することがあります。
- ・ファンドに関する投資信託説明書(請求目論見書)を含む詳細な情報は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
 - ・本書には、約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されていません。
 - ・ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
 - ・ファンドの商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認します。
 - ・ファンドの財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
 - ・請求目論見書は、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。(請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようお願いいたします。)
 - ・有価証券届出書の効力の発生の有無については、委託会社のホームページにて確認いただけます。効力が発生するまでに、本書の記載内容が訂正される場合があります。
- (3) 投資信託説明書(請求目論見書)に信託約款を掲載します。
- (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29年6月28日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	弥永 めぐみ	印
--------------------	-------	--------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山田 信之	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、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記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国際投信株式会社の平成29年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績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

会社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。

独立監査人の監査報告書

平成29年9月20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 大畑 茂 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 和田 渉 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28年8月11日から平成29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29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。