

## 【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書  
【提出先】 関東財務局長  
【提出日】 平成28年4月15日  
【計算期間】 第18特定期間（自平成27年7月18日 至平成28年1月18日）  
【ファンド名】 三菱UFJ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）  
【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 金上 孝  
【本店の所在の場所】 東京都千代田区有楽町一丁目12番1号  
【事務連絡者氏名】 伊藤 晃  
【連絡場所】 東京都千代田区有楽町一丁目12番1号  
【電話番号】 03-6250-4740  
【縦覧に供する場所】 該当ありません

【提出書類】 募集事項等記載書面  
【提出先】 関東財務局長  
【提出日】 平成28年4月15日  
【発行者名】 三菱UFJ国際投信株式会社  
【代表者の役職氏名】 取締役社長 金上 孝  
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 三菱UFJ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）  
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 継続募集額 上限1兆円  
【縦覧に供する場所】 該当ありません

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

**【証券情報】****(1) 【ファンドの名称】**

三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型)(「ファンド」といいます。)

**(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】**

追加型証券投資信託です。

当初元本は1口当たり1円です。

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

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

**(3) 【発行(売出)価額の総額】**

1兆円を上限とします。

**(4) 【発行(売出)価格】**

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

(略称：世国債イ)

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

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

ホームページアドレス <http://www.am.mufg.jp/>

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

なお、当ファンドでは1万口当たりの価額で表示されます。

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

**(5) 【申込手数料】**

申込手数料はかかりません。

**(6) 【申込単位】**

申込単位は販売会社にご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

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

申込みには分配金受取りコース(一般コース)と分配金再投資コース(累積投資コース)があり、分配金再投資コース(累積投資コース)の場合、再投資される収益分配金については1口単位とします。

**(7) 【申込期間】**

平成28年4月16日から平成29年4月14日までです。

(注)上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

**(8) 【申込取扱場所】**

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

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

(9) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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

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

(10) 【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社とします。

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権の振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

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

(12) 【その他】

該当事項はありません。

## 【有価証券報告書】

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに概ね連動することを  
目指して運用を行います。

信託金の限度額は、3,000億円です。

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

## 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
		債券		
追加型	海外	不動産投信	MRF	特殊型 ( )
	内外	その他資産 ( )	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  その他 (シティ世界 国債インデッ クス(除く日 本、円ベース))	条件付運用型  ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型  その他 ( )
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (債券 一般 クレジット属性 (高格付債)))						
資産複合 ( )						

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

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

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

### 商品分類の定義

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

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

### 属性区分の定義

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

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

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

## [ ファンドの目的・特色 ]

## ファンドの目的

日本を除く世界各国の公社債を実質的な主要投資対象とし、日本を除く世界主要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）の動きに概ね連動することをめざします。

## ファンドの特色



**特色1** 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通じて、日本を除く世界各国の公社債への投資を行います。なお、公社債、短期金融商品に直接投資することがあります。



**特色2** シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）<sup>※1</sup>の動きに概ね連動すること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<sup>※2</sup>とします。

※1 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、22カ国で構成されています（2016年1月末現在、国名は50音順）。ただし、構成国は変わる可能性があります。

※2 ベンチマークとは、ファンドの運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指標です。

### ＜運用プロセスのイメージ＞

#### ステップ1：投資対象ユニバースの作成

ベンチマーク採用銘柄を主要投資対象とします。

#### ステップ2：ポートフォリオ案の作成

モニタリング結果に加えて、ファンドの資金動向やベンチマーク構成の変動などを考慮してポートフォリオ案を作成します。

#### ステップ3：売買執行

売買執行の際には、売買コストの抑制に留意します。

#### ステップ4：モニタリング

一連の投資行動を分析し、その結果をポートフォリオに反映することで、運用の継続的な改善に努めます。

**!** 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。





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。



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

なお、ムーディーズ・インベスターズ・サービス(Moody's)のBaからCaaまでの格付けには「1, 2, 3」、スタンダード・アンド・プアーズ(S&P)のBB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。

### 特色 3

#### 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<sup>※</sup>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。

### 特色 4

#### 組入れ国債等の利子・配当収益を中心に、原則として毎月分配を行う方針です。

毎月17日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、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、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないこともあります。また、分配金額は運用実績に応じて変動します。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。

※基準価額が当初元本である1万円(1万口当たり)を下回る場合においても、利子・配当収益を中心に分配を行う方針です。

## 収益分配金に関する留意事項

- ◆分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



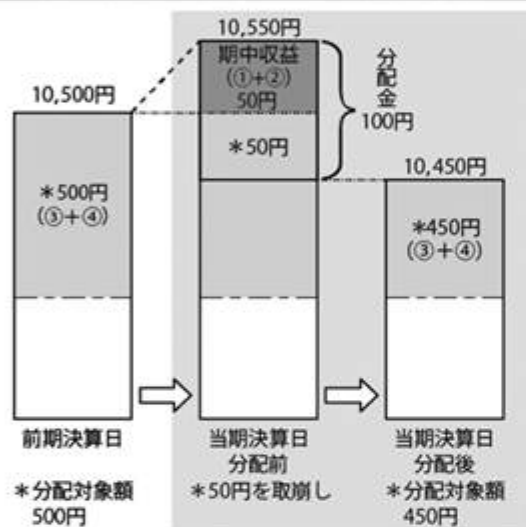
- ◆分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。

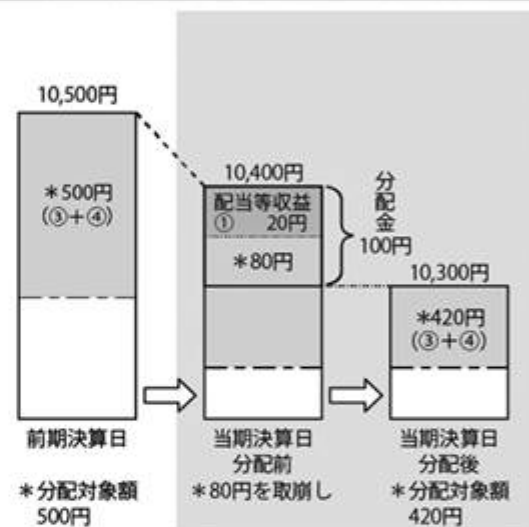
分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

## 計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

## 前期決算日から基準価額が上昇した場合



## 前期決算日から基準価額が下落した場合



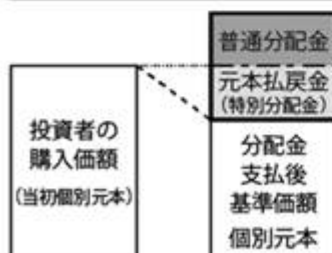
※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

分配準備積立金：当期の①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益のうち、当期分配金として支払わなかった残りの金額をいいます。信託財産に留保され、次期以降の分配金の支払いに充当できる分配対象額となります。

収益調整金：追加型投資信託で追加設定が行われることによって、既存の受益者への収益分配可能額が薄まらないようにするために設けられた勘定です。

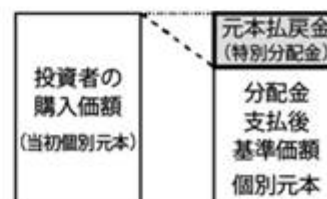
- ◆投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

## 分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



※元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

## 分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



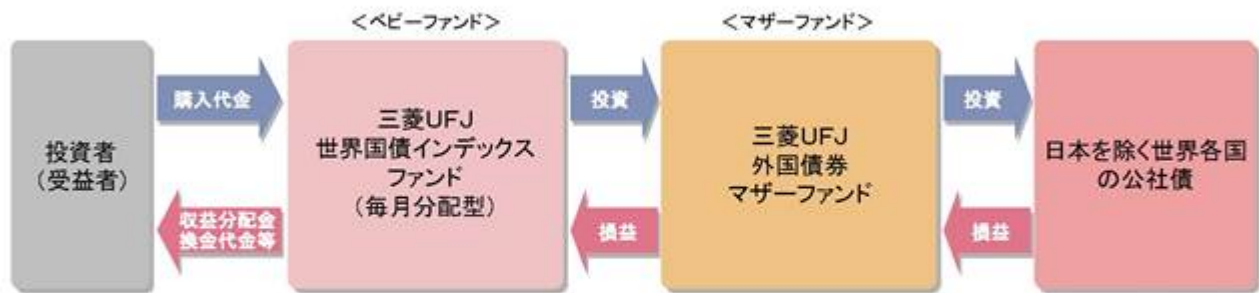
普通分配金：個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金(特別分配金)：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

(注) 普通分配金に対する課税については、「4 手数料等及び税金 (5) 課税上の取扱い」をご参照ください。

## ■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

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

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19年4月19日 設定日、信託契約締結、運用開始

## (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。	信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。
投資 損益	
マザーファンド	
投資 損益	
有価証券等	

## 委託会社と関係法人との契約の概要

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

## 委託会社の概況

- ・資本金  
2,000百万円（平成28年1月末現在）
- ・沿革
  - 平成9年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
  - 平成16年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
  - 平成17年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更
  - 平成27年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更
- ・大株主の状況（平成28年1月末現在）

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、公社債、短期金融商品に直接投資することがあります。

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、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに概ね連動することを目指して運用を行います。

受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

対象インデックスの動きに概ね連動する運用を維持するため、先物取引等を利用し公社債の実質投資比率が100%を超える場合があります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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)【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する三菱UFJ 外国債券マザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

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

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から11. の証券または証書の性質を有するもの

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

#### 金融商品の指図範囲

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

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

#### その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・ 外国為替予約取引

#### <三菱UFJ 外国債券マザーファンドの概要>

##### (基本方針)

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

##### (運用方法)

###### 投資対象

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

###### 投資態度

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

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

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

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



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

(投資制限)

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

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

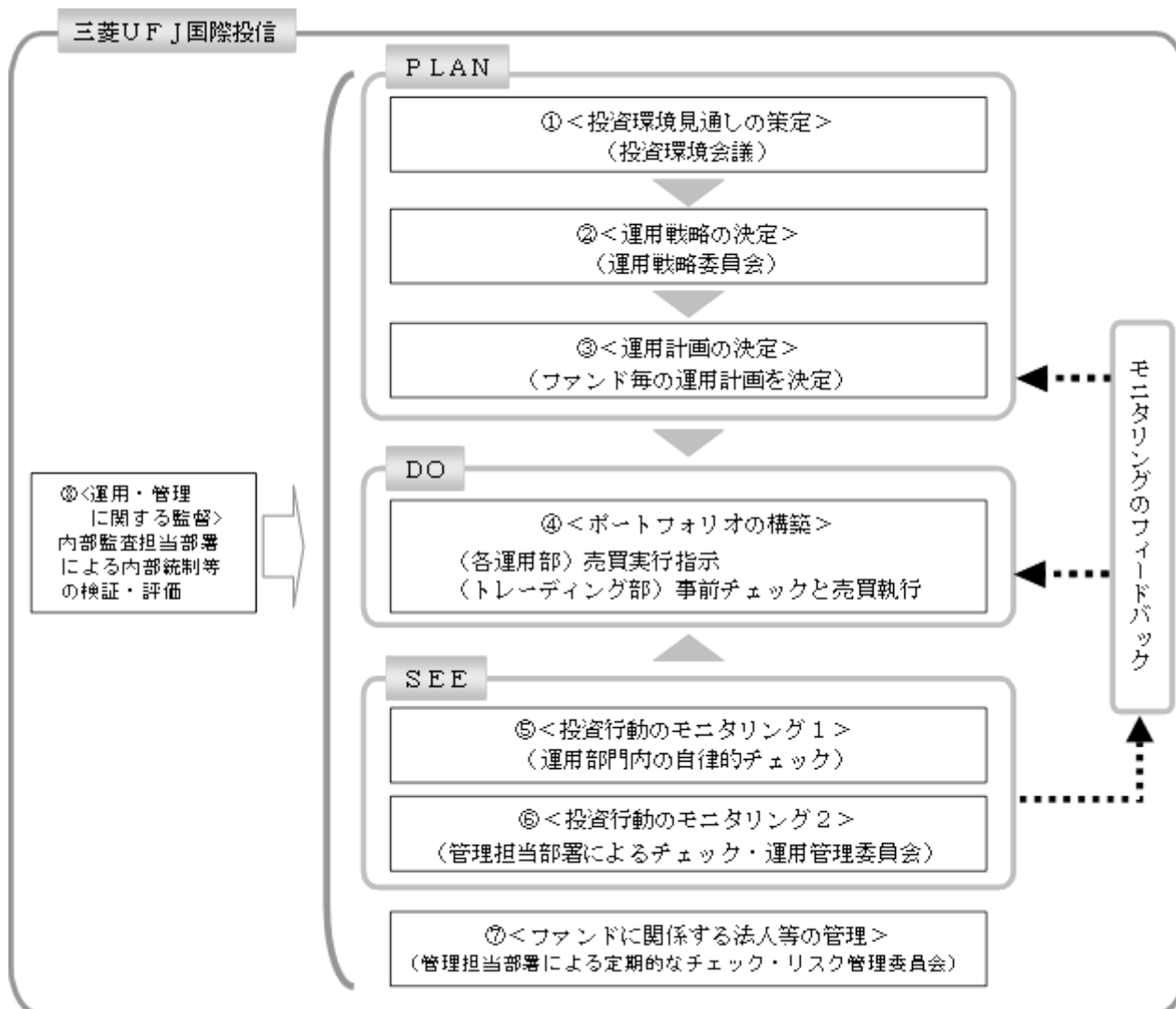
同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

## (3) 【運用体制】

**投資環境見通しの策定**

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

**運用戦略の決定**

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

**運用計画の決定**

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

**ポートフォリオの構築**

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

**投資行動のモニタリング1**

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

**投資行動のモニタリング2**

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

**ファンドに係る法人等の管理**

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

**運用・管理に関する監督**



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

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

#### (4)【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

収益分配金額は、利子・配当収益を中心に、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、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。

収益の分配にあてなかった利益については、信託約款に定める運用の基本方針に基づいて運用を行います。

#### (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マザーファンド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、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

新株引受権証券および新株予約権証券

- a. 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マザーファンド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。
- b. a.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

投資信託証券

- a. 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マザーファンド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。
- b. a.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

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マザーファンド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. a.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該株式の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- c. 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マザーファンド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。

- d. c. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占め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割合を乗じて得た額とします。

#### 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。)の時価総額とマザーファンド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、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンド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とします。

#### 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. 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出した価額で評価するものとします。
- 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ます。

#### 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り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ます。
- b. a. の信用取引の指図は、当該売付けに係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. の売付けに係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ます。

#### 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、信託財産に係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ます。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)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. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- d. 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ます。

#### 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、当該借入れに係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. の借入れに係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ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)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. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

#### 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および金融商品取引所に準ず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出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し付けること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. に規定す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り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(信託財産により借り入れた公社債を含みます。)の引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、当該売付けに係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. の売付けに係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、制限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。

<その他法令等に定められた投資制限>

- ・同一の法人の発行する株式への投資制限

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

### 3【投資リスク】

#### (1) 投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

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

価格変動リスク

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

為替変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

### 留意事項

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・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）の動きに概ね連動することをめざして運用を行いますが、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に違いが生じること、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、分配金を準備するためにファンド内に資金が滞留すること等の要因により乖離を生じることがあります。

### （２）投資リスクに対する管理体制

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

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

各投資リスクに関する管理体制は以下の通りです。

#### 価格変動リスク・為替変動リスク

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

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

#### 信用リスク

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

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

#### 流動性リスク

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



## (3) 代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

## ●ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移



- ・ファンドの年間騰落率とは、当該各月末の基準価額(分配金再投資)から当該各月末の1年前の基準価額(分配金再投資)を控除した額を当該各月末の1年前の基準価額(分配金再投資)で除して得た数に100を乗じて得た数をいいます。
- ・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。

## ●ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2011年2月末～2016年1月末)



- ・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。
- ・全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- ・2011年2月～2016年1月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

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、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(国債)はそのサブインデックスです。わが国の国債で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI(国債)は野村證券株式会社の知的財産であり、運用成果等に関し、野村證券株式会社は一切関係ありません。
先進国債	シティ世界国債インデックス(除く日本)	シティ世界国債インデックス(除く日本)は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	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】

申込手数料はかかりません。

## (2)【換金（解約）手数料】

解約手数料はかかりません。

換金の詳細については販売会社にご確認ください。

## (3)【信託報酬等】

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

信託財産の純資産総額 × 年0.81%（税抜 年0.75%）

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

上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

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

委託会社	販売会社	受託会社
年0.432% (税抜 年0.4%)	年0.324% (税抜 年0.3%)	年0.054% (税抜 年0.05%)

信託報酬は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。

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

## (4)【その他の手数料等】

信託財産に係る監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等相当額は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。

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

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

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

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

## 費用または費用を対価とする役務の内容について

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

上記は一般的な用語について説明したものです。

受益者が直接的に負担する費用か、間接的に負担する費用かの区別です。

## （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

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

## １．収益分配金の課税

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

## ２．解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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



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

#### 法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

#### 個別元本について

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

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

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

#### 収益分配金について

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

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

上記は平成28年1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】

## (1)【投資状況】

平成28年1月29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	1,269,411,063	100.00
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		59,295	0.00
純資産総額		1,269,470,358	100.00

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

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## a 評価額上位30銘柄

平成28年1月29日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)	償還期限 (年/月/日)	
日本	三菱UFJ 外国債券マザー ファンド	親投資信託 受益証券		461,990,415	2.6394 2.7477	1,219,389,907 1,269,411,063		100.00

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

## b 全銘柄の種類/業種別投資比率

平成28年1月29日現在

種類/業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3)【運用実績】

## 【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成28年1月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額	基準価額 (1万口当たりの純資産価額)
第1計算期間末日 (平成19年 5月17日)	611,038,407 (分配付) 609,050,977 (分配落)	10,137 (分配付) 10,104 (分配落)
第2計算期間末日 (平成19年 6月18日)	1,008,339,764 (分配付) 1,005,042,026 (分配落)	10,089 (分配付) 10,056 (分配落)
第3計算期間末日 (平成19年 7月17日)	1,236,943,700 (分配付) 1,232,947,773 (分配落)	10,210 (分配付) 10,177 (分配落)
第4計算期間末日 (平成19年 8月17日)	1,401,015,022 (分配付) 1,396,164,420 (分配落)	9,531 (分配付) 9,498 (分配落)
第5計算期間末日 (平成19年 9月18日)	1,521,531,805 (分配付) 1,516,468,100 (分配落)	9,888 (分配付) 9,855 (分配落)
第6計算期間末日 (平成19年10月17日)	1,542,893,985 (分配付) 1,537,845,625 (分配落)	10,077 (分配付) 10,044 (分配落)
第7計算期間末日 (平成19年11月19日)	1,517,198,304 (分配付) 1,512,200,421 (分配落)	10,000 (分配付) 9,967 (分配落)
第8計算期間末日 (平成19年12月17日)	1,629,391,785 (分配付) 1,624,004,961 (分配落)	9,980 (分配付) 9,947 (分配落)
第9計算期間末日 (平成20年 1月17日)	1,657,365,877 (分配付) 1,651,728,458 (分配落)	9,699 (分配付) 9,666 (分配落)

第10計算期間末日 （平成20年 2月18日）	1,753,350,024（分配付） 1,747,429,165（分配落）	9,772（分配付） 9,739（分配落）
第11計算期間末日 （平成20年 3月17日）	1,789,918,451（分配付） 1,783,587,863（分配落）	9,330（分配付） 9,297（分配落）
第12計算期間末日 （平成20年 4月17日）	1,843,765,021（分配付） 1,837,456,398（分配落）	9,643（分配付） 9,610（分配落）
第13計算期間末日 （平成20年 5月19日）	1,893,550,752（分配付） 1,887,074,826（分配落）	9,620（分配付） 9,587（分配落）
第14計算期間末日 （平成20年 6月17日）	1,903,431,919（分配付） 1,896,958,037（分配落）	9,700（分配付） 9,667（分配落）
第15計算期間末日 （平成20年 7月17日）	1,934,078,200（分配付） 1,927,516,152（分配落）	9,712（分配付） 9,679（分配落）
第16計算期間末日 （平成20年 8月18日）	1,955,050,662（分配付） 1,948,454,852（分配落）	9,781（分配付） 9,748（分配落）
第17計算期間末日 （平成20年 9月17日）	1,896,648,995（分配付） 1,889,906,850（分配落）	9,283（分配付） 9,250（分配落）
第18計算期間末日 （平成20年10月17日）	1,685,827,488（分配付） 1,679,271,719（分配落）	8,486（分配付） 8,453（分配落）
第19計算期間末日 （平成20年11月17日）	1,547,780,827（分配付） 1,541,186,325（分配落）	7,744（分配付） 7,711（分配落）
第20計算期間末日 （平成20年12月17日）	1,611,804,005（分配付） 1,605,048,095（分配落）	7,872（分配付） 7,839（分配落）
第21計算期間末日 （平成21年 1月19日）	1,610,187,566（分配付） 1,603,354,849（分配落）	7,776（分配付） 7,743（分配落）
第22計算期間末日 （平成21年 2月17日）	1,583,467,880（分配付） 1,578,850,657（分配落）	7,542（分配付） 7,520（分配落）
第23計算期間末日 （平成21年 3月17日）	1,709,950,565（分配付） 1,705,325,135（分配落）	8,116（分配付） 8,094（分配落）
第24計算期間末日 （平成21年 4月17日）	1,779,713,990（分配付） 1,775,042,251（分配落）	8,371（分配付） 8,349（分配落）
第25計算期間末日 （平成21年 5月18日）	1,715,866,130（分配付） 1,711,175,585（分配落）	8,030（分配付） 8,008（分配落）
第26計算期間末日 （平成21年 6月17日）	1,751,320,697（分配付） 1,746,646,158（分配落）	8,230（分配付） 8,208（分配落）
第27計算期間末日 （平成21年 7月17日）	1,756,500,096（分配付） 1,751,788,097（分配落）	8,177（分配付） 8,155（分配落）
第28計算期間末日 （平成21年 8月17日）	1,777,016,802（分配付） 1,772,325,220（分配落）	8,333（分配付） 8,311（分配落）
第29計算期間末日 （平成21年 9月17日）	1,773,101,462（分配付） 1,768,375,184（分配落）	8,232（分配付） 8,210（分配落）
第30計算期間末日 （平成21年10月19日）	1,804,803,633（分配付） 1,799,995,332（分配落）	8,252（分配付） 8,230（分配落）
第31計算期間末日 （平成21年11月17日）	1,777,904,731（分配付） 1,773,133,722（分配落）	8,180（分配付） 8,158（分配落）
第32計算期間末日 （平成21年12月17日）	1,764,594,756（分配付） 1,759,780,512（分配落）	8,055（分配付） 8,033（分配落）
第33計算期間末日 （平成22年 1月18日）	1,773,510,204（分配付） 1,768,664,969（分配落）	8,053（分配付） 8,031（分配落）
第34計算期間末日 （平成22年 2月17日）	1,743,667,645（分配付） 1,738,760,703（分配落）	7,818（分配付） 7,796（分配落）
第35計算期間末日 （平成22年 3月17日）	1,750,002,132（分配付） 1,745,092,670（分配落）	7,842（分配付） 7,820（分配落）
第36計算期間末日 （平成22年 4月19日）	1,756,128,023（分配付） 1,751,228,121（分配落）	7,885（分配付） 7,863（分配落）
第37計算期間末日 （平成22年 5月17日）	1,701,575,430（分配付） 1,696,641,794（分配落）	7,588（分配付） 7,566（分配落）
第38計算期間末日 （平成22年 6月17日）	1,687,201,360（分配付） 1,682,241,736（分配落）	7,484（分配付） 7,462（分配落）
第39計算期間末日 （平成22年 7月20日）	1,683,320,000（分配付） 1,678,300,939（分配落）	7,378（分配付） 7,356（分配落）

第40計算期間末日 (平成22年 8月17日)	1,683,124,442 (分配付) 1,678,076,462 (分配落)	7,335 (分配付) 7,313 (分配落)
第41計算期間末日 (平成22年 9月17日)	1,701,824,325 (分配付) 1,696,758,929 (分配落)	7,391 (分配付) 7,369 (分配落)
第42計算期間末日 (平成22年10月18日)	1,671,557,647 (分配付) 1,666,505,242 (分配落)	7,279 (分配付) 7,257 (分配落)
第43計算期間末日 (平成22年11月17日)	1,631,400,998 (分配付) 1,627,778,608 (分配落)	7,206 (分配付) 7,190 (分配落)
第44計算期間末日 (平成22年12月17日)	1,584,400,395 (分配付) 1,580,799,644 (分配落)	7,040 (分配付) 7,024 (分配落)
第45計算期間末日 (平成23年 1月17日)	1,566,542,003 (分配付) 1,562,967,025 (分配落)	7,011 (分配付) 6,995 (分配落)
第46計算期間末日 (平成23年 2月17日)	1,571,621,231 (分配付) 1,568,049,478 (分配落)	7,040 (分配付) 7,024 (分配落)
第47計算期間末日 (平成23年 3月17日)	1,528,899,332 (分配付) 1,525,320,544 (分配落)	6,835 (分配付) 6,819 (分配落)
第48計算期間末日 (平成23年 4月18日)	1,604,429,795 (分配付) 1,600,873,957 (分配落)	7,219 (分配付) 7,203 (分配落)
第49計算期間末日 (平成23年 5月17日)	1,574,018,030 (分配付) 1,570,447,139 (分配落)	7,053 (分配付) 7,037 (分配落)
第50計算期間末日 (平成23年 6月17日)	1,585,823,746 (分配付) 1,582,235,129 (分配落)	7,070 (分配付) 7,054 (分配落)
第51計算期間末日 (平成23年 7月19日)	1,544,813,913 (分配付) 1,541,214,662 (分配落)	6,867 (分配付) 6,851 (分配落)
第52計算期間末日 (平成23年 8月17日)	1,550,655,336 (分配付) 1,547,077,782 (分配落)	6,935 (分配付) 6,919 (分配落)
第53計算期間末日 (平成23年 9月20日)	1,520,748,292 (分配付) 1,517,163,139 (分配落)	6,787 (分配付) 6,771 (分配落)
第54計算期間末日 (平成23年10月17日)	1,520,186,263 (分配付) 1,516,609,537 (分配落)	6,800 (分配付) 6,784 (分配落)
第55計算期間末日 (平成23年11月17日)	1,475,239,560 (分配付) 1,471,691,743 (分配落)	6,653 (分配付) 6,637 (分配落)
第56計算期間末日 (平成23年12月19日)	1,488,706,131 (分配付) 1,485,165,767 (分配落)	6,728 (分配付) 6,712 (分配落)
第57計算期間末日 (平成24年 1月17日)	1,434,971,988 (分配付) 1,431,486,785 (分配落)	6,588 (分配付) 6,572 (分配落)
第58計算期間末日 (平成24年 2月17日)	1,484,989,088 (分配付) 1,481,544,625 (分配落)	6,898 (分配付) 6,882 (分配落)
第59計算期間末日 (平成24年 3月19日)	1,551,556,059 (分配付) 1,548,140,586 (分配落)	7,268 (分配付) 7,252 (分配落)
第60計算期間末日 (平成24年 4月17日)	1,499,103,508 (分配付) 1,495,688,382 (分配落)	7,023 (分配付) 7,007 (分配落)
第61計算期間末日 (平成24年 5月17日)	1,498,034,097 (分配付) 1,494,581,382 (分配落)	6,942 (分配付) 6,926 (分配落)
第62計算期間末日 (平成24年 6月18日)	1,485,777,917 (分配付) 1,482,316,556 (分配落)	6,868 (分配付) 6,852 (分配落)
第63計算期間末日 (平成24年 7月17日)	1,475,446,686 (分配付) 1,471,977,829 (分配落)	6,805 (分配付) 6,789 (分配落)
第64計算期間末日 (平成24年 8月17日)	1,478,859,248 (分配付) 1,475,383,173 (分配落)	6,807 (分配付) 6,791 (分配落)
第65計算期間末日 (平成24年 9月18日)	1,503,804,225 (分配付) 1,500,336,461 (分配落)	6,938 (分配付) 6,922 (分配落)
第66計算期間末日 (平成24年10月17日)	1,511,175,853 (分配付) 1,507,714,171 (分配落)	6,985 (分配付) 6,969 (分配落)
第67計算期間末日 (平成24年11月19日)	1,545,680,064 (分配付) 1,542,228,433 (分配落)	7,165 (分配付) 7,149 (分配落)
第68計算期間末日 (平成24年12月17日)	1,596,899,373 (分配付) 1,593,493,971 (分配落)	7,503 (分配付) 7,487 (分配落)
第69計算期間末日 (平成25年 1月17日)	1,610,179,577 (分配付) 1,606,927,230 (分配落)	7,921 (分配付) 7,905 (分配落)

第70計算期間末日 （平成25年 2月18日）	1,627,759,249（分配付） 1,624,618,064（分配落）	8,291（分配付） 8,275（分配落）
第71計算期間末日 （平成25年 3月18日）	1,579,655,075（分配付） 1,576,599,063（分配落）	8,270（分配付） 8,254（分配落）
第72計算期間末日 （平成25年 4月17日）	1,581,483,173（分配付） 1,578,585,274（分配落）	8,732（分配付） 8,716（分配落）
第73計算期間末日 （平成25年 5月17日）	1,582,189,239（分配付） 1,579,376,051（分配落）	8,999（分配付） 8,983（分配落）
第74計算期間末日 （平成25年 6月17日）	1,399,461,074（分配付） 1,396,778,502（分配落）	8,347（分配付） 8,331（分配落）
第75計算期間末日 （平成25年 7月17日）	1,419,562,212（分配付） 1,416,913,140（分配落）	8,574（分配付） 8,558（分配落）
第76計算期間末日 （平成25年 8月19日）	1,373,638,406（分配付） 1,371,026,035（分配落）	8,413（分配付） 8,397（分配落）
第77計算期間末日 （平成25年 9月17日）	1,388,436,048（分配付） 1,385,830,705（分配落）	8,527（分配付） 8,511（分配落）
第78計算期間末日 （平成25年10月17日）	1,385,435,644（分配付） 1,382,862,953（分配落）	8,616（分配付） 8,600（分配落）
第79計算期間末日 （平成25年11月18日）	1,390,075,343（分配付） 1,387,540,268（分配落）	8,773（分配付） 8,757（分配落）
第80計算期間末日 （平成25年12月17日）	1,362,767,152（分配付） 1,360,360,558（分配落）	9,060（分配付） 9,044（分配落）
第81計算期間末日 （平成26年 1月17日）	1,302,753,667（分配付） 1,300,473,269（分配落）	9,141（分配付） 9,125（分配落）
第82計算期間末日 （平成26年 2月17日）	1,279,702,591（分配付） 1,277,422,697（分配落）	8,981（分配付） 8,965（分配落）
第83計算期間末日 （平成26年 3月17日）	1,298,766,843（分配付） 1,296,479,256（分配落）	9,084（分配付） 9,068（分配落）
第84計算期間末日 （平成26年 4月17日）	1,315,526,750（分配付） 1,313,235,381（分配落）	9,186（分配付） 9,170（分配落）
第85計算期間末日 （平成26年 5月19日）	1,310,399,636（分配付） 1,308,107,921（分配落）	9,149（分配付） 9,133（分配落）
第86計算期間末日 （平成26年 6月17日）	1,308,461,456（分配付） 1,306,171,771（分配落）	9,143（分配付） 9,127（分配落）
第87計算期間末日 （平成26年 7月17日）	1,301,784,071（分配付） 1,299,507,924（分配落）	9,151（分配付） 9,135（分配落）
第88計算期間末日 （平成26年 8月18日）	1,318,485,699（分配付） 1,316,209,146（分配落）	9,267（分配付） 9,251（分配落）
第89計算期間末日 （平成26年 9月17日）	1,343,287,257（分配付） 1,341,013,272（分配落）	9,452（分配付） 9,436（分配落）
第90計算期間末日 （平成26年10月17日）	1,341,191,243（分配付） 1,338,915,441（分配落）	9,429（分配付） 9,413（分配落）
第91計算期間末日 （平成26年11月17日）	1,410,163,822（分配付） 1,407,946,724（分配落）	10,177（分配付） 10,161（分配落）
第92計算期間末日 （平成26年12月17日）	1,392,845,626（分配付） 1,390,683,801（分配落）	10,309（分配付） 10,293（分配落）
第93計算期間末日 （平成27年 1月19日）	1,360,285,841（分配付） 1,358,135,163（分配落）	10,120（分配付） 10,104（分配落）
第94計算期間末日 （平成27年 2月17日）	1,339,435,731（分配付） 1,337,307,109（分配落）	10,068（分配付） 10,052（分配落）
第95計算期間末日 （平成27年 3月17日）	1,341,650,092（分配付） 1,339,507,574（分配落）	10,019（分配付） 10,003（分配落）
第96計算期間末日 （平成27年 4月17日）	1,331,260,455（分配付） 1,329,129,260（分配落）	9,994（分配付） 9,978（分配落）
第97計算期間末日 （平成27年 5月18日）	1,345,618,950（分配付） 1,343,485,964（分配落）	10,094（分配付） 10,078（分配落）
第98計算期間末日 （平成27年 6月17日）	1,332,514,484（分配付） 1,330,412,332（分配落）	10,142（分配付） 10,126（分配落）
第99計算期間末日 （平成27年 7月17日）	1,301,976,540（分配付） 1,299,908,054（分配落）	10,071（分配付） 10,055（分配落）

第100計算期間末日 (平成27年 8月17日)	1,328,568,512 (分配付) 1,326,495,189 (分配落)	10,253 (分配付) 10,237 (分配落)
第101計算期間末日 (平成27年 9月17日)	1,285,060,414 (分配付) 1,282,985,640 (分配落)	9,910 (分配付) 9,894 (分配落)
第102計算期間末日 (平成27年10月19日)	1,293,229,221 (分配付) 1,291,153,215 (分配落)	9,967 (分配付) 9,951 (分配落)
第103計算期間末日 (平成27年11月17日)	1,282,849,894 (分配付) 1,280,778,986 (分配落)	9,911 (分配付) 9,895 (分配落)
第104計算期間末日 (平成27年12月17日)	1,272,840,844 (分配付) 1,270,776,060 (分配落)	9,863 (分配付) 9,847 (分配落)
第105計算期間末日 (平成28年 1月18日)	1,228,076,843 (分配付) 1,226,001,062 (分配落)	9,466 (分配付) 9,450 (分配落)
平成27年 1月末日	1,355,641,122	10,117
2月末日	1,340,087,291	10,121
3月末日	1,344,974,600	10,056
4月末日	1,338,243,362	10,030
5月末日	1,354,760,883	10,206
6月末日	1,312,754,949	10,027
7月末日	1,312,113,547	10,142
8月末日	1,289,609,681	9,962
9月末日	1,286,890,255	9,913
10月末日	1,283,211,198	9,897
11月末日	1,275,842,824	9,867
12月末日	1,255,565,091	9,708
平成28年 1月末日	1,269,470,358	9,835

## 【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	33円
第2計算期間	33円
第3計算期間	33円
第4計算期間	33円
第5計算期間	33円
第6計算期間	33円
第7計算期間	33円
第8計算期間	33円
第9計算期間	33円
第10計算期間	33円
第11計算期間	33円
第12計算期間	33円
第13計算期間	33円
第14計算期間	33円
第15計算期間	33円
第16計算期間	33円
第17計算期間	33円
第18計算期間	33円
第19計算期間	33円
第20計算期間	33円
第21計算期間	33円
第22計算期間	22円
第23計算期間	22円
第24計算期間	22円
第25計算期間	22円
第26計算期間	22円
第27計算期間	22円
第28計算期間	22円
第29計算期間	22円
第30計算期間	22円
第31計算期間	22円

第32計算期間	22円
第33計算期間	22円
第34計算期間	22円
第35計算期間	22円
第36計算期間	22円
第37計算期間	22円
第38計算期間	22円
第39計算期間	22円
第40計算期間	22円
第41計算期間	22円
第42計算期間	22円
第43計算期間	16円
第44計算期間	16円
第45計算期間	16円
第46計算期間	16円
第47計算期間	16円
第48計算期間	16円
第49計算期間	16円
第50計算期間	16円
第51計算期間	16円
第52計算期間	16円
第53計算期間	16円
第54計算期間	16円
第55計算期間	16円
第56計算期間	16円
第57計算期間	16円
第58計算期間	16円
第59計算期間	16円
第60計算期間	16円
第61計算期間	16円
第62計算期間	16円
第63計算期間	16円
第64計算期間	16円
第65計算期間	16円
第66計算期間	16円
第67計算期間	16円
第68計算期間	16円
第69計算期間	16円
第70計算期間	16円
第71計算期間	16円
第72計算期間	16円
第73計算期間	16円
第74計算期間	16円
第75計算期間	16円
第76計算期間	16円
第77計算期間	16円
第78計算期間	16円
第79計算期間	16円
第80計算期間	16円
第81計算期間	16円
第82計算期間	16円
第83計算期間	16円
第84計算期間	16円
第85計算期間	16円
第86計算期間	16円
第87計算期間	16円
第88計算期間	16円
第89計算期間	16円
第90計算期間	16円

第91計算期間	16円
第92計算期間	16円
第93計算期間	16円
第94計算期間	16円
第95計算期間	16円
第96計算期間	16円
第97計算期間	16円
第98計算期間	16円
第99計算期間	16円
第100計算期間	16円
第101計算期間	16円
第102計算期間	16円
第103計算期間	16円
第104計算期間	16円
第105計算期間	16円

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	1.37
第2計算期間	0.14
第3計算期間	1.53
第4計算期間	6.34
第5計算期間	4.10
第6計算期間	2.25
第7計算期間	0.43
第8計算期間	0.13
第9計算期間	2.49
第10計算期間	1.09
第11計算期間	4.19
第12計算期間	3.72
第13計算期間	0.10
第14計算期間	1.17
第15計算期間	0.46
第16計算期間	1.05
第17計算期間	4.77
第18計算期間	8.25
第19計算期間	8.38
第20計算期間	2.08
第21計算期間	0.80
第22計算期間	2.59
第23計算期間	7.92
第24計算期間	3.42
第25計算期間	3.82
第26計算期間	2.77
第27計算期間	0.37
第28計算期間	2.18
第29計算期間	0.95
第30計算期間	0.51
第31計算期間	0.60
第32計算期間	1.26
第33計算期間	0.24
第34計算期間	2.65
第35計算期間	0.59
第36計算期間	0.83
第37計算期間	3.49
第38計算期間	1.08
第39計算期間	1.12
第40計算期間	0.28
第41計算期間	1.06



第42計算期間	1.22
第43計算期間	0.70
第44計算期間	2.08
第45計算期間	0.18
第46計算期間	0.64
第47計算期間	2.69
第48計算期間	5.86
第49計算期間	2.08
第50計算期間	0.46
第51計算期間	2.65
第52計算期間	1.22
第53計算期間	1.90
第54計算期間	0.42
第55計算期間	1.93
第56計算期間	1.37
第57計算期間	1.84
第58計算期間	4.96
第59計算期間	5.60
第60計算期間	3.15
第61計算期間	0.92
第62計算期間	0.83
第63計算期間	0.68
第64計算期間	0.26
第65計算期間	2.16
第66計算期間	0.91
第67計算期間	2.81
第68計算期間	4.95
第69計算期間	5.79
第70計算期間	4.88
第71計算期間	0.06
第72計算期間	5.79
第73計算期間	3.24
第74計算期間	7.08
第75計算期間	2.91
第76計算期間	1.69
第77計算期間	1.54
第78計算期間	1.23
第79計算期間	2.01
第80計算期間	3.46
第81計算期間	1.07
第82計算期間	1.57
第83計算期間	1.32
第84計算期間	1.30
第85計算期間	0.22
第86計算期間	0.10
第87計算期間	0.26
第88計算期間	1.44
第89計算期間	2.17
第90計算期間	0.07
第91計算期間	8.11
第92計算期間	1.45
第93計算期間	1.68
第94計算期間	0.35
第95計算期間	0.32
第96計算期間	0.08
第97計算期間	1.16
第98計算期間	0.63
第99計算期間	0.54
第100計算期間	1.96

第101計算期間	3.19
第102計算期間	0.73
第103計算期間	0.40
第104計算期間	0.32
第105計算期間	3.86

（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1計算期間	616,811,523	14,005,375	602,806,148
第2計算期間	501,542,683	104,923,889	999,424,942
第3計算期間	298,754,033	86,703,352	1,211,475,623
第4計算期間	318,627,631	60,223,691	1,469,879,563
第5計算期間	137,746,465	68,809,029	1,538,816,999
第6計算期間	64,243,587	72,014,044	1,531,046,542
第7計算期間	95,608,055	109,487,285	1,517,167,312
第8計算期間	142,626,542	27,193,273	1,632,600,581
第9計算期間	108,493,886	32,250,993	1,708,843,474
第10計算期間	136,378,482	51,021,977	1,794,199,979
第11計算期間	166,140,510	41,980,220	1,918,360,269
第12計算期間	109,539,096	115,822,354	1,912,077,011
第13計算期間	96,881,713	40,601,139	1,968,357,585
第14計算期間	73,317,078	79,436,076	1,962,238,587
第15計算期間	104,581,221	75,406,628	1,991,413,180
第16計算期間	74,718,355	67,401,126	1,998,730,409
第17計算期間	89,615,520	45,267,346	2,043,078,583
第18計算期間	95,394,118	151,868,836	1,986,603,865
第19計算期間	67,304,740	55,309,031	1,998,599,574
第20計算期間	72,640,287	23,619,856	2,047,620,005
第21計算期間	48,607,136	25,450,627	2,070,776,514
第22計算期間	45,151,635	16,519,045	2,099,409,104
第23計算期間	37,129,275	29,583,683	2,106,954,696
第24計算期間	42,005,705	22,938,427	2,126,021,974
第25計算期間	36,439,120	25,673,717	2,136,787,377
第26計算期間	51,692,037	60,410,986	2,128,068,428
第27計算期間	44,808,820	24,730,430	2,148,146,818
第28計算期間	37,587,959	53,197,124	2,132,537,653
第29計算期間	47,899,852	26,619,758	2,153,817,747
第30計算期間	52,221,798	18,920,129	2,187,119,416
第31計算期間	38,890,923	52,570,039	2,173,440,300
第32計算期間	63,251,965	45,939,348	2,190,752,917
第33計算期間	39,852,405	28,225,350	2,202,379,972
第34計算期間	63,921,739	35,873,127	2,230,428,584
第35計算期間	39,413,386	38,268,085	2,231,573,885
第36計算期間	46,618,143	50,963,707	2,227,228,321
第37計算期間	52,767,653	37,434,030	2,242,561,944
第38計算期間	34,241,337	22,428,506	2,254,374,775
第39計算期間	40,162,364	13,145,503	2,281,391,636
第40計算期間	27,282,038	14,137,164	2,294,536,510
第41計算期間	29,420,211	21,503,900	2,302,452,821
第42計算期間	26,283,107	32,187,843	2,296,548,085
第43計算期間	30,269,324	62,823,100	2,263,994,309
第44計算期間	25,487,613	39,011,980	2,250,469,942
第45計算期間	26,070,718	42,179,184	2,234,361,476
第46計算期間	26,140,310	28,155,987	2,232,345,799
第47計算期間	54,409,526	50,012,488	2,236,742,837
第48計算期間	34,055,092	48,398,870	2,222,399,059

第49計算期間	31,018,916	21,610,969	2,231,807,006
第50計算期間	25,697,843	14,619,061	2,242,885,788
第51計算期間	20,330,287	13,683,888	2,249,532,187
第52計算期間	25,752,732	39,313,469	2,235,971,450
第53計算期間	20,422,136	15,672,906	2,240,720,680
第54計算期間	17,786,289	23,052,854	2,235,454,115
第55計算期間	17,639,985	35,708,159	2,217,385,941
第56計算期間	19,204,198	23,862,039	2,212,728,100
第57計算期間	17,369,523	51,845,371	2,178,252,252
第58計算期間	17,873,825	43,336,334	2,152,789,743
第59計算期間	15,744,132	33,862,846	2,134,671,029
第60計算期間	16,734,024	16,951,220	2,134,453,833
第61計算期間	29,982,027	6,488,621	2,157,947,239
第62計算期間	18,361,721	12,958,132	2,163,350,828
第63計算期間	20,095,186	15,410,371	2,168,035,643
第64計算期間	22,230,119	17,718,470	2,172,547,292
第65計算期間	15,752,437	20,946,760	2,167,352,969
第66計算期間	14,626,256	18,427,926	2,163,551,299
第67計算期間	14,719,788	21,001,464	2,157,269,623
第68計算期間	20,798,987	49,691,771	2,128,376,839
第69計算期間	29,671,683	125,331,467	2,032,717,055
第70計算期間	17,404,428	86,880,792	1,963,240,691
第71計算期間	14,320,310	67,552,942	1,910,008,059
第72計算期間	17,905,200	116,726,045	1,811,187,214
第73計算期間	14,263,276	67,207,904	1,758,242,586
第74計算期間	14,477,880	96,112,903	1,676,607,563
第75計算期間	10,530,802	31,468,263	1,655,670,102
第76計算期間	11,906,354	34,844,268	1,632,732,188
第77計算期間	12,389,645	16,782,268	1,628,339,565
第78計算期間	11,168,006	31,575,361	1,607,932,210
第79計算期間	13,287,127	36,797,134	1,584,422,203
第80計算期間	13,525,838	93,826,657	1,504,121,384
第81計算期間	39,747,627	118,619,801	1,425,249,210
第82計算期間	12,634,094	12,949,365	1,424,933,939
第83計算期間	14,094,702	9,286,616	1,429,742,025
第84計算期間	18,840,956	16,476,760	1,432,106,221
第85計算期間	14,491,419	14,275,533	1,432,322,107
第86計算期間	11,558,246	12,826,656	1,431,053,697
第87計算期間	37,798,775	46,260,100	1,422,592,372
第88計算期間	12,444,557	12,190,866	1,422,846,063
第89計算期間	17,779,380	19,384,589	1,421,240,854
第90計算期間	30,073,620	28,937,871	1,422,376,603
第91計算期間	18,239,363	54,929,408	1,385,686,558
第92計算期間	13,813,892	48,359,363	1,351,141,087
第93計算期間	15,173,134	22,140,064	1,344,174,157
第94計算期間	10,982,417	24,767,806	1,330,388,768
第95計算期間	21,558,350	12,873,251	1,339,073,867
第96計算期間	13,331,748	20,408,457	1,331,997,158
第97計算期間	11,718,614	10,599,240	1,333,116,532
第98計算期間	8,756,377	28,027,619	1,313,845,290
第99計算期間	9,373,453	30,414,966	1,292,803,777
第100計算期間	9,184,969	6,161,478	1,295,827,268
第101計算期間	10,912,769	10,006,007	1,296,734,030
第102計算期間	8,548,972	7,779,080	1,297,503,922
第103計算期間	8,108,941	11,294,867	1,294,317,996
第104計算期間	7,788,982	11,616,625	1,290,490,353
第105計算期間	10,847,005	3,974,206	1,297,363,152

&lt; 参考 &gt;

## 「三菱UFJ」外国債券マザーファンド」

## (1) 投資状況

平成28年1月29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	40,272,280,968	42.45
	イタリア	9,046,332,033	9.53
	フランス	8,986,217,813	9.47
	イギリス	7,544,573,698	7.95
	ドイツ	7,030,387,961	7.41
	スペイン	5,045,870,941	5.32
	ベルギー	2,385,813,226	2.51
	オランダ	2,359,894,689	2.49
	カナダ	1,821,763,646	1.92
	オーストラリア	1,638,603,631	1.73
	オーストリア	1,468,035,650	1.55
	メキシコ	856,147,566	0.90
	アイルランド	734,779,289	0.77
	デンマーク	580,783,581	0.61
	フィンランド	572,646,350	0.60
	ポーランド	496,568,725	0.52
	スウェーデン	444,383,631	0.47
	マレーシア	431,728,305	0.46
	南アフリカ	364,408,019	0.38
	シンガポール	326,912,078	0.34
ノルウェー	257,888,927	0.27	
スイス	254,461,200	0.27	
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		1,958,298,190	2.08
純資産総額		94,878,780,117	100.00

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

## (2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成28年1月29日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	券面総額	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
アメリカ	2 T-NOTE 250815	国債証券		3,900,000.00	11,927.46 12,103.9973	465,171,213 472,055,895	2.000000 2025/08/15	0.50
アメリカ	1.375 T-NOTE 201031	国債証券		3,900,000.00	11,923.57 12,086.0557	465,019,582 471,356,172	1.375000 2020/10/31	0.50
アメリカ	2.125 T-NOTE 250515	国債証券		3,700,000.00	12,000.06 12,246.5861	444,002,330 453,123,688	2.125000 2025/05/15	0.48
アメリカ	1.125 T-NOTE 180615	国債証券		3,600,000.00	12,131.72 12,145.0742	436,741,988 437,222,672	1.125000 2018/06/15	0.46
アメリカ	2.875 T-BOND 430515	国債証券		3,400,000.00	11,674.83 12,328.7400	396,944,332 419,177,160	2.875000 2043/05/15	0.44
アメリカ	0.625 T-NOTE 170531	国債証券		3,400,000.00	12,077.33 12,067.6419	410,629,233 410,299,824	0.625000 2017/05/31	0.43
アメリカ	1.875 T-NOTE 200630	国債証券		3,300,000.00	12,271.56 12,366.5118	404,961,760 408,094,891	1.875000 2020/06/30	0.43
アメリカ	2.25 T-NOTE 241115	国債証券		3,200,000.00	12,078.53 12,393.8964	386,513,251 396,604,687	2.250000 2024/11/15	0.42
アメリカ	2 T-NOTE 250215	国債証券		3,200,000.00	11,802.95 12,130.4376	377,694,576 388,174,005	2.000000 2025/02/15	0.41
アメリカ	2 T-NOTE 230215	国債証券		3,100,000.00	12,026.56 12,305.1325	372,823,515 381,459,109	2.000000 2023/02/15	0.40
アメリカ	3.375 T-BOND 440515	国債証券		2,800,000.00	12,856.94 13,551.6044	359,994,373 379,444,924	3.375000 2044/05/15	0.40
アメリカ	2.625 T-NOTE 200815	国債証券		2,900,000.00	12,669.59 12,751.3128	367,418,208 369,788,071	2.625000 2020/08/15	0.39
アメリカ	1.5 T-NOTE 200531	国債証券		3,000,000.00	12,019.31 12,180.4853	360,579,384 365,414,561	1.500000 2020/05/31	0.39
アメリカ	2.375 T-NOTE 240815	国債証券		2,900,000.00	12,228.41 12,527.0423	354,624,119 363,284,227	2.375000 2024/08/15	0.38

アメリカ	0.875 T-NOTE 170515	国債証券	3,000,000.00	12,144.12 12,109.1909	364,323,897 363,275,728	0.875000 2017/05/15	0.38
アメリカ	1.75 T-NOTE 230515	国債証券	3,000,000.00	11,759.44 12,070.0026	352,783,269 362,100,079	1.750000 2023/05/15	0.38
アメリカ	0.625 T-NOTE 170930	国債証券	3,000,000.00	12,039.31 12,051.5888	361,179,389 361,547,665	0.625000 2017/09/30	0.38
アメリカ	2.5 T-NOTE 240515	国債証券	2,800,000.00	12,386.75 12,654.5224	346,829,212 354,326,627	2.500000 2024/05/15	0.37
アメリカ	1.375 T-NOTE 180930	国債証券	2,900,000.00	12,207.21 12,211.6471	354,009,132 354,137,768	1.375000 2018/09/30	0.37
アメリカ	0.875 T-NOTE 170430	国債証券	2,900,000.00	12,146.96 12,112.9681	352,261,921 351,276,075	0.875000 2017/04/30	0.37
アメリカ	0.75 T-NOTE 170315	国債証券	2,900,000.00	12,125.24 12,095.4986	351,632,075 350,769,461	0.750000 2017/03/15	0.37
アメリカ	3.125 T-BOND 430215	国債証券	2,700,000.00	12,256.21 12,948.1987	330,917,886 349,601,366	3.125000 2043/02/15	0.37
アメリカ	2.75 T-NOTE 231115	国債証券	2,700,000.00	12,657.78 12,915.1483	341,760,166 348,709,004	2.750000 2023/11/15	0.37
フランス	4.25 O.A.T 231025	国債証券	2,000,000.00	17,123.94 17,158.9702	342,478,904 343,179,405	4.250000 2023/10/25	0.36
アメリカ	1.375 T-NOTE 200430	国債証券	2,800,000.00	12,037.20 12,117.2175	337,041,643 339,282,090	1.375000 2020/04/30	0.36
アメリカ	0.625 T-NOTE 170831	国債証券	2,800,000.00	12,049.53 12,055.3660	337,386,848 337,550,248	0.625000 2017/08/31	0.36
アメリカ	2.5 T-NOTE 230815	国債証券	2,600,000.00	12,432.72 12,705.5144	323,250,761 330,343,375	2.500000 2023/08/15	0.35
フランス	3.25 O.A.T 211025	国債証券	2,100,000.00	15,630.83 15,643.6412	328,247,631 328,516,465	3.250000 2021/10/25	0.35
アメリカ	1.25 T-NOTE 181115	国債証券	2,700,000.00	12,095.88 12,165.8487	326,588,790 328,477,915	1.250000 2018/11/15	0.35
フランス	4.25 O.A.T 171025	国債証券	2,300,000.00	14,624.61 14,280.3076	336,366,041 328,447,075	4.250000 2017/10/25	0.35

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

#### b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成28年1月29日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	97.94
合計	97.94

(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

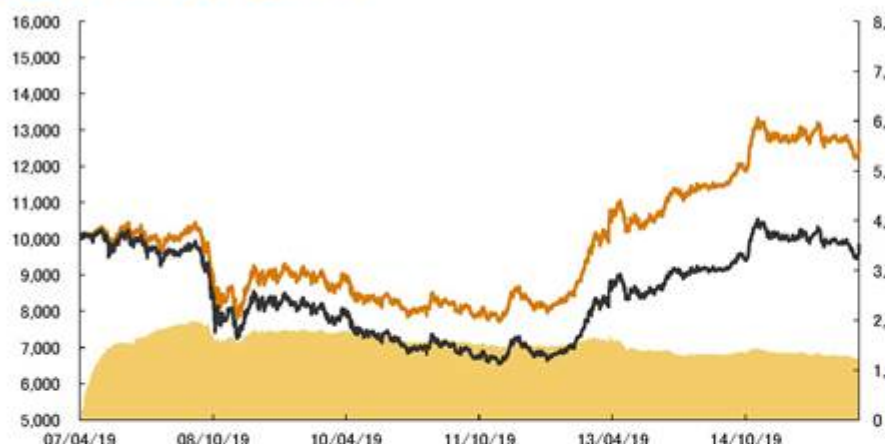
該当事項はありません。

[ 参考情報 ]



## 運用実績

### ■基準価額・純資産の推移(設定日～2016年1月29日)



— 純資産総額(百万円)【右目盛】 — 基準価額(分配金再投資)【左目盛】 — 基準価額【左目盛】

- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は10,000を起点として表示
- ・基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を再投資したもものとして計算

### ■分配の推移

2016年 1月	16円
2015年 12月	16円
2015年 11月	16円
2015年 10月	16円
2015年 9月	16円
2015年 8月	16円
直近1年間累計	192円
設定来累計	2,163円

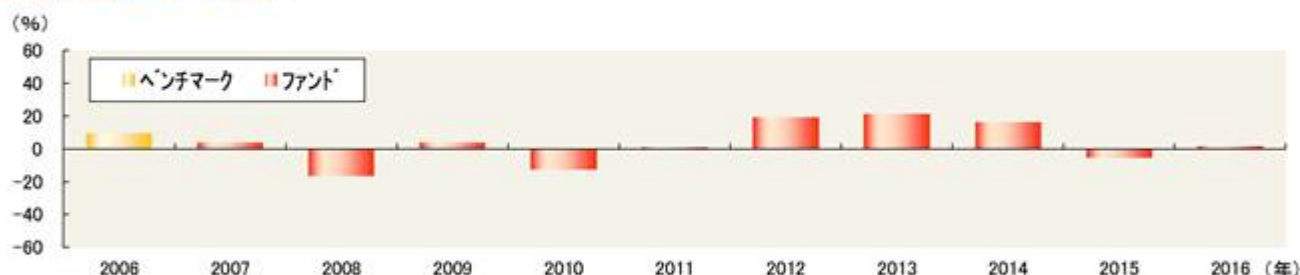
・分配金は1万口当たり、税引前

### ■主要な資産の状況(2016年1月29日現在)

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	42.8%	1 2 T-NOTE 250815	国債	アメリカ	0.5%
ユーロ	40.3%	2 1.375 T-NOTE 201031	国債	アメリカ	0.5%
イギリスポンド	8.1%	3 2.125 T-NOTE 250515	国債	アメリカ	0.5%
カナダドル	1.9%	4 1.125 T-NOTE 180615	国債	アメリカ	0.5%
オーストラリアドル	1.7%	5 2.875 T-BOND 430515	国債	アメリカ	0.4%
メキシコペソ	0.9%	6 0.625 T-NOTE 170531	国債	アメリカ	0.4%
円	0.8%	7 1.875 T-NOTE 200630	国債	アメリカ	0.4%
デンマーククローネ	0.6%	8 2.25 T-NOTE 241115	国債	アメリカ	0.4%
その他	2.9%	9 2 T-NOTE 250215	国債	アメリカ	0.4%
合計	100.0%	10 2 T-NOTE 230215	国債	アメリカ	0.4%

・各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

### ■年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2007年は設定日から年末までの、2016年は1月29日までの収益率を表示
- ・2006年はベンチマークの年間収益率(委託会社の計算日基準)を表示

- ・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
- ・ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
- ・ファンドの運用状況等は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

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

## 2【換金（解約）手続等】

解約の受付	原則として、いつでも解約の請求ができます。
解約単位	販売会社が定める単位
解約価額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額
信託財産留保額	ありません。
解約価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
解約価額の照会方法	解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。 なお、下記においてもご照会いただけます。 三菱UFJ国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) ホームページアドレス <a href="http://www.am.mufg.jp/">http://www.am.mufg.jp/</a>
支払開始日	原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。

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

換金の詳細については販売会社にご確認ください。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

#### (2)【保管】

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



## (3) 【信託期間】

信託期間	平成19年4月19日から無期限 ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。
------	---

## (4) 【計算期間】

計算期間	原則として、毎月18日から翌月17日まで 上記にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日が休業日のとき、各計算期間終了日は、この該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日はファンドの信託期間終了日とします。
------	---

## (5) 【その他】

ファンドの償還条件等	委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。（任意償還） ・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合 ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃されたときまたはやむを得ない事情が発生したとき このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。 委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。
信託約款の変更	委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。委託会社は、信託約款を変更しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。
ファンドの償還等に関する開示方法	委託会社は、ファンドの任意償還または信託約款の変更のうち重大な内容の変更を行おうとする場合、あらかじめその旨およびその内容を公告し、かつ、原則としてこれらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。この公告および書面には、原則として、受益者で異議のあるものは一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。
異議申立ておよび反対者の買取請求権	受益者は、委託会社がファンドの任意償還または信託約款について重大な内容の変更を行おうとする場合、原則として、一定の期間（1ヵ月以上）内に委託会社に対して異議を述べるすることができます。異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。なお、一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、ファンドの償還または信託約款の変更を行いません。その場合、償還しない旨または信託約款を変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、原則として、これらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。
関係法人との契約の更改	委託会社と販売会社との間で締結された「募集・販売の取扱い等に関する契約」の期間は、契約締結日から1ヵ年とし、期間満了3ヵ月前までに相手方に対し、何らの意思表示のないときは、同一の条件で契約を更新するものとし、その後も同様とします。
運用報告書	委託会社は、毎年1月および7月に終了する計算期間の末日および償還時に、交付運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更等があった場合は、その内容を交付運用報告書に記載します。

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い	委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。
受託会社の辞任および解任に伴う取扱い	受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。
信託事務処理の再信託	受託会社は、ファンドの信託事務の処理の一部について日本マスタートラスト信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託します。日本マスタートラスト信託銀行株式会社は、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。
公告	委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。 <a href="http://www.am.mufg.jp/">http://www.am.mufg.jp/</a> なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 4【受益者の権利等】

受益者の権利の主な内容は以下の通りです。

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 毎月決算ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成していません。
- 3 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期(平成27年7月18日から平成28年1月18日まで)の財務諸表について、PwCあらた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世界国債インデックスファンド（毎月分配型）】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 [平成27年7月17日現在]	当期 [平成28年1月18日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,136,865	999,348
親投資信託受益証券	1,299,702,424	1,225,805,596
未収入金	2,012,100	2,229,600
未収利息	1	1
流動資産合計	1,302,851,390	1,229,034,545
資産合計	1,302,851,390	1,229,034,545
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	2,068,486	2,075,781
未払解約金	-	68,147
未払受託者報酬	58,001	58,975
未払委託者報酬	811,989	825,635
その他未払費用	4,860	4,945
流動負債合計	2,943,336	3,033,483
負債合計	2,943,336	3,033,483
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sub>1</sub> 1,292,803,777	<sub>1</sub> 1,297,363,152
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	<sub>2</sub> 7,104,277	<sub>2</sub> 71,362,090
(分配準備積立金)	196,582,175	189,853,706
元本等合計	1,299,908,054	1,226,001,062
純資産合計	1,299,908,054	1,226,001,062
負債純資産合計	1,302,851,390	1,229,034,545

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期		当期	
	自 平成27年 1月20日 至 平成27年 7月17日		自 平成27年 7月18日 至 平成28年 1月18日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		240		196
有価証券売買等損益		11,590,600		60,638,928
営業収益合計		11,590,840		60,638,732
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		353,552		350,721
委託者報酬		4,949,666		4,910,020
その他費用		29,634		29,404
営業費用合計		5,332,852		5,290,145
営業利益又は営業損失( )		6,257,988		65,928,877
経常利益又は経常損失( )		6,257,988		65,928,877
当期純利益又は当期純損失( )		6,257,988		65,928,877
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( )		6,492		333,825
期首剰余金又は期首欠損金( )		13,961,006		7,104,277
剰余金増加額又は欠損金減少額		517,701		478,617
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		22,686		320,175
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		495,015		158,442
剰余金減少額又は欠損金増加額		932,951		914,356
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		932,951		270,303
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		644,053
分配金		1 12,705,959		1 12,435,576
期末剰余金又は期末欠損金( )		7,104,277		71,362,090

## (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。
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの特定期間 当ファンドは、原則として毎年1月17日および7月17日を特定期間の末日としておりますが、当特定期間においては当該日が休業日のため、当特定期間は平成27年7月18日から平成28年1月18日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	前期 [平成27年7月17日現在]	当期 [平成28年1月18日現在]
1 期首元本額	1,344,174,157円	1,292,803,777円
期中追加設定元本額	75,720,959円	55,391,638円
期中一部解約元本額	127,091,339円	50,832,263円
2 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。		71,362,090円
3 受益権の総数	1,292,803,777口	1,297,363,152口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0055円 (10,055円)	0.9450円 (9,450円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期(自平成27年1月20日 至平成27年7月17日)

## 1 分配金の計算過程

(自平成27年1月20日 至平成27年2月17日)		
費用控除後の配当等収益額	A	1,932,380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	33,675,551円
分配準備積立金額	D	211,556,299円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	247,164,230円
当ファンドの期末残存口数	F	1,330,388,768口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,857円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	2,128,622円

(自平成27年2月18日 至平成27年3月17日)		
費用控除後の配当等収益額	A	1,924,693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	37,320,536円
分配準備積立金額	D	209,322,762円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	248,567,991円
当ファンドの期末残存口数	F	1,339,073,867口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,856円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	2,142,518円

(自平成27年3月18日 至平成27年4月17日)		
費用控除後の配当等収益額	A	2,059,876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	39,197,114円
分配準備積立金額	D	205,936,170円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	247,193,160円
当ファンドの期末残存口数	F	1,331,997,158口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,855円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	2,131,195円

( 自 平成27年4月18日 至 平成27年5月18日 )		
費用控除後の配当等収益額	A	2,865,582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	41,041,120円
分配準備積立金額	D	204,236,065円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	248,142,767円
当ファンドの期末残存口数	F	1,333,116,532口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,861円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	2,132,986円

( 自 平成27年5月19日 至 平成27年6月17日 )		
費用控除後の配当等収益額	A	2,686,362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	41,783,022円
分配準備積立金額	D	200,675,710円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	245,145,094円
当ファンドの期末残存口数	F	1,313,845,290口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,865円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	2,102,152円

( 自 平成27年6月18日 至 平成27年7月17日 )		
費用控除後の配当等収益額	A	2,032,829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	42,539,964円
分配準備積立金額	D	196,617,832円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	241,190,625円
当ファンドの期末残存口数	F	1,292,803,777口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,865円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	2,068,486円

当期(自 平成27年7月18日 至 平成28年1月18日)

1 分配金の計算過程

( 自 平成27年7月18日 至 平成27年8月17日 )		
費用控除後の配当等収益額	A	2,911,032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	44,039,316円
分配準備積立金額	D	195,648,586円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	242,598,934円
当ファンドの期末残存口数	F	1,295,827,268口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,872円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	2,073,323円

( 自 平成27年8月18日 至 平成27年9月17日 )		
費用控除後の配当等収益額	A	2,008,340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	45,727,441円
分配準備積立金額	D	194,974,399円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	242,710,180円
当ファンドの期末残存口数	F	1,296,734,030口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,871円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	2,074,774円

(自平成27年9月18日 至 平成27年10月19日)		
費用控除後の配当等収益額	A	2,725,103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	47,042,985円
分配準備積立金額	D	193,742,884円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	243,510,972円
当ファンドの期末残存口数	F	1,297,503,922口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,876円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金額	I=F*H/10,000	2,076,006円

(自平成27年10月20日 至 平成27年11月17日)		
費用控除後の配当等収益額	A	1,811,525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	48,142,615円
分配準備積立金額	D	192,705,689円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	242,659,829円
当ファンドの期末残存口数	F	1,294,317,996口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,874円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金額	I=F*H/10,000	2,070,908円

(自平成27年11月18日 至 平成27年12月17日)		
費用控除後の配当等収益額	A	1,903,044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	49,158,441円
分配準備積立金額	D	190,724,719円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	241,786,204円
当ファンドの期末残存口数	F	1,290,490,353口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,873円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金額	I=F*H/10,000	2,064,784円

(自平成27年12月18日 至 平成28年1月18日)		
費用控除後の配当等収益額	A	1,951,366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	51,029,252円
分配準備積立金額	D	189,978,121円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	242,958,739円
当ファンドの期末残存口数	F	1,297,363,152口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,872円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金額	I=F*H/10,000	2,075,781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	前期 (自平成27年1月20日 至平成27年7月17日)	当期 (自平成27年7月18日 至平成28年1月18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。	同左  同左



3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	同 左  同 左
------------------	--	----------------

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 [ 平成27年7月17日現在 ]	当期 [ 平成28年1月18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	<p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	同 左  同 左  同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同 左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	前期 [ 平成27年7月17日現在 ] 最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期 [ 平成28年1月18日現在 ] 最終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	6,052,986	48,205,579
合計	6,052,986	48,205,579

## （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	464,408,258	1,225,805,596	
	親投資信託受益証券 小計	464,408,258	1,225,805,596	
合計		464,408,258	1,225,805,596	

## 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。

## &lt;参考&gt;

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

「三菱UFJ」外国債券マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

## (1) 貸借対照表

	[ 平成27年7月17日現在 ]	[ 平成28年1月18日現在 ]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金		240,939,985
コール・ローン	664,602,162	44,265,914
国債証券	117,864,985,730	91,566,716,681
派生商品評価勘定	165,765	2,793,295
未収入金	495,241,424	590,378,512
未収利息	1,067,723,269	825,709,504
前払費用	30,062,579	26,162,606
流動資産合計	120,122,780,929	93,296,966,497
資産合計	120,122,780,929	93,296,966,497
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	303,502	
未払解約金	795,768,019	468,499,244
流動負債合計	796,071,521	468,499,244
負債合計	796,071,521	468,499,244
純資産の部		
元本等		
元本	1	43,079,622,623
剰余金		35,168,478,107
剰余金又は欠損金( )	76,247,086,785	57,659,989,146
元本等合計	119,326,709,408	92,828,467,253
純資産合計	119,326,709,408	92,828,467,253
負債純資産合計	120,122,780,929	93,296,966,497

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

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

	[ 平成27年7月17日現在 ]	[ 平成28年1月18日現在 ]
1 期首		
期首元本額	平成27年1月20日 53,203,395,055円	平成27年7月18日 43,079,622,623円
期首からの追加設定元本額	1,809,422,997円	1,284,334,545円
期首からの一部解約元本額	11,933,195,429円	9,195,479,061円
元本の内訳*		
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	129,723,549円	135,317,258円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	248,921,826円	258,423,527円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	161,977,399円	166,198,386円
三菱UFJ 外国債券オープン	1,653,826,852円	1,618,489,274円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	887,969,157円	966,820,601円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	2,321,717,889円	2,447,675,986円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	1,511,130,953円	1,547,717,555円
三菱UFJ 財産分散ファンド(毎月決算型)	732,545,944円	643,310,493円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	694,669,661円	658,467,220円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	89,979,789円	87,268,567円
FPバランスファンド(安定型)	77,506,923円	77,225,537円
FPバランスファンド(安定成長型)	103,972,800円	100,887,865円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	93,502,528円	111,116,323円
三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金)	2,034,224,480円	2,062,864,040円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型)	469,223,591円	464,408,258円

三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)	1,283,361,920円	1,283,874,635円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	28,762,557,344円	20,734,814,281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)	157,646円	48,504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)	734,077円	734,757円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2(適格機関投資家限定)	84,643,324円	75,578,098円
MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)	1,737,274,971円	1,727,236,942円
(合計)	43,079,622,623円	35,168,478,107円
2 受益権の総数	43,079,622,623口	35,168,478,107口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.7699円 (27,699円)	2.6395円 (26,395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1月20日 至平成27年7月17日)	(自平成27年7月18日 至平成28年1月18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。	同 左
	デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成27年7月17日現在]	[平成28年1月18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。	同 左
	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。	同 左
	上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	[平成27年7月17日現在]	[平成28年1月18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	1,295,981,312	241,651,921
合計	1,295,981,312	241,651,921

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

## 通貨関連

区 分	種 類	[ 平成27年7月17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	73,084,405		73,295,700	211,295
	カナダドル	3,831,520		3,830,800	720
	オーストラリアドル	2,739,150		2,763,600	24,450
	イギリスポンド	13,553,400		13,573,700	20,300
	シンガポールドル	1,813,380		1,818,000	4,620
	マレーシアリングgit	3,888,000		3,921,600	33,600
	スウェーデンクローネ	1,018,500		1,017,100	1,400
	ノルウェークローネ	606,680		608,400	1,720
	デンマーククローネ	1,089,510		1,087,200	2,310
	メキシコペソ	1,567,680		1,568,000	320
	ポーランドズロチ	984,018		985,800	1,782
	南アフリカランド	996,750		1,002,000	5,250
	ユーロ	65,042,770		64,881,600	161,170
	合 計	170,215,763		170,353,500	137,737

区 分	種 類	[ 平成28年1月18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	245,704,515		244,613,600	1,090,915
	カナダドル	11,421,035		11,239,200	181,835
	オーストラリアドル	9,783,540		9,640,600	142,940
	イギリスポンド	47,354,740		46,706,800	647,940
	スイスフラン	1,168,500		1,168,400	100
	シンガポールドル	1,633,650		1,625,800	7,850
	マレーシアリングgit	2,403,000		2,388,600	14,400
	スウェーデンクローネ	3,318,872		3,271,200	47,672
	ノルウェークローネ	1,990,825		1,978,500	12,325
	デンマーククローネ	4,283,493		4,280,000	3,493
	メキシコペソ	5,219,844		5,112,000	107,844
	ポーランドズロチ	3,784,441		3,702,400	82,041
	南アフリカランド	2,745,860		2,706,600	39,260
	ユーロ	231,624,080		231,209,400	414,680
	合 計	572,436,395		569,643,100	2,793,295

## （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を用いております。  
（ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （3）附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## （1）株式

該当事項はありません。

## （2）株式以外の有価証券

（単位：円）

通 貨		券面総額	評 価 額	備 考
種 類	銘 柄			
アメリカドル				
国債証券	0.5 T-NOTE 170731	2,500,000.00	2,488,378.90	
	0.625 T-NOTE 170215	2,700,000.00	2,698,207.02	

0.625 T-NOTE 170531	3,400,000.00	3,392,695.31
0.625 T-NOTE 170831	2,800,000.00	2,790,921.87
0.625 T-NOTE 170930	3,000,000.00	2,989,101.56
0.625 T-NOTE 171130	1,400,000.00	1,393,492.18
0.625 T-NOTE 180430	800,000.00	794,000.00
0.75 T-NOTE 170315	2,900,000.00	2,901,019.52
0.75 T-NOTE 170630	3,300,000.00	3,297,550.77
0.75 T-NOTE 171031	2,700,000.00	2,694,832.02
0.75 T-NOTE 171231	1,700,000.00	1,695,683.59
0.75 T-NOTE 180228	1,500,000.00	1,494,667.96
0.75 T-NOTE 180331	400,000.00	398,468.75
0.75 T-NOTE 180415	500,000.00	497,753.90
0.875 T-NOTE 161231	900,000.00	901,757.81
0.875 T-NOTE 170131	1,600,000.00	1,603,124.99
0.875 T-NOTE 170228	1,100,000.00	1,102,062.50
0.875 T-NOTE 170415	1,500,000.00	1,502,871.09
0.875 T-NOTE 170430	2,900,000.00	2,904,531.25
0.875 T-NOTE 170515	3,000,000.00	3,004,570.31
0.875 T-NOTE 170615	1,100,000.00	1,101,417.96
0.875 T-NOTE 170815	1,300,000.00	1,300,964.84
0.875 T-NOTE 171015	1,300,000.00	1,300,457.03
0.875 T-NOTE 180131	1,400,000.00	1,399,289.06
0.875 T-NOTE 181015	2,400,000.00	2,389,218.74
0.875 T-NOTE 190731	200,000.00	197,609.37
1 T-NOTE 170331	1,200,000.00	1,203,843.75
1 T-NOTE 170915	2,000,000.00	2,005,234.37
1 T-NOTE 171215	300,000.00	300,738.28
1 T-NOTE 180315	400,000.00	400,703.12
1 T-NOTE 180815	700,000.00	699,535.15
1 T-NOTE 180915	2,400,000.00	2,398,031.24
1 T-NOTE 190630	700,000.00	695,406.25
1 T-NOTE 190831	700,000.00	694,039.06
1 T-NOTE 190930	900,000.00	891,703.12
1 T-NOTE 191130	900,000.00	890,015.62
1.125 T-NOTE 180615	4,900,000.00	4,916,269.52
1.125 T-NOTE 190531	100,000.00	99,789.06
1.125 T-NOTE 191231	1,400,000.00	1,390,265.62
1.125 T-NOTE 200331	1,400,000.00	1,387,312.50
1.25 T-NOTE 181115	2,700,000.00	2,713,816.40
1.25 T-NOTE 181130	1,500,000.00	1,507,324.21
1.25 T-NOTE 181215	1,700,000.00	1,708,566.40
1.25 T-NOTE 190131	2,000,000.00	2,008,125.00
1.25 T-NOTE 190430	800,000.00	801,875.00
1.25 T-NOTE 191031	900,000.00	899,507.81
1.25 T-NOTE 200131	1,500,000.00	1,495,429.68
1.25 T-NOTE 200229	100,000.00	99,632.81
1.375 T-NOTE 180731	1,600,000.00	1,614,750.00
1.375 T-NOTE 180930	2,900,000.00	2,925,828.12
1.375 T-NOTE 181130	1,100,000.00	1,109,496.09
1.375 T-NOTE 181231	1,400,000.00	1,411,320.31
1.375 T-NOTE 190228	1,700,000.00	1,712,617.18
1.375 T-NOTE 200131	1,100,000.00	1,102,062.50
1.375 T-NOTE 200229	2,900,000.00	2,904,078.12
1.375 T-NOTE 200331	2,500,000.00	2,501,757.81
1.375 T-NOTE 200430	2,800,000.00	2,800,656.25
1.375 T-NOTE 200831	700,000.00	699,015.62
1.375 T-NOTE 200930	2,600,000.00	2,593,093.75
1.375 T-NOTE 201031	3,900,000.00	3,887,507.81
1.5 T-NOTE 180831	1,000,000.00	1,012,500.00
1.5 T-NOTE 181231	1,600,000.00	1,618,750.00
1.5 T-NOTE 190131	2,300,000.00	2,326,593.75
1.5 T-NOTE 190228	1,500,000.00	1,517,226.56
1.5 T-NOTE 190331	900,000.00	909,773.43
1.5 T-NOTE 190531	1,700,000.00	1,717,531.25
1.5 T-NOTE 191031	1,600,000.00	1,613,000.00
1.5 T-NOTE 191130	700,000.00	705,578.12
1.5 T-NOTE 200531	3,700,000.00	3,720,234.37

1.5 T-NOTE 220131	1,700,000.00	1,683,132.81	
1.625 T-NOTE 190331	2,000,000.00	2,030,000.00	
1.625 T-NOTE 190430	1,500,000.00	1,522,148.43	
1.625 T-NOTE 190630	1,900,000.00	1,927,312.50	
1.625 T-NOTE 190731	1,400,000.00	1,419,250.00	
1.625 T-NOTE 191231	1,100,000.00	1,113,492.18	
1.625 T-NOTE 201130	2,100,000.00	2,118,046.87	
1.625 T-NOTE 220815	600,000.00	595,828.12	
1.625 T-NOTE 221115	2,200,000.00	2,179,203.12	
1.75 T-NOTE 181031	1,200,000.00	1,222,453.12	
1.75 T-NOTE 190930	900,000.00	916,242.18	
1.75 T-NOTE 201031	1,500,000.00	1,519,101.56	
1.75 T-NOTE 220228	700,000.00	702,515.62	
1.75 T-NOTE 220331	2,000,000.00	2,004,843.75	
1.75 T-NOTE 220430	1,700,000.00	1,703,054.68	
1.75 T-NOTE 220515	2,300,000.00	2,304,402.34	
1.75 T-NOTE 220930	1,400,000.00	1,397,921.87	
1.75 T-NOTE 230515	3,000,000.00	2,982,890.62	
1.875 T-NOTE 170831	1,900,000.00	1,931,097.65	
1.875 T-NOTE 170930	1,700,000.00	1,728,753.90	
1.875 T-NOTE 171031	1,700,000.00	1,729,683.59	
1.875 T-NOTE 200630	3,300,000.00	3,368,320.31	
1.875 T-NOTE 211130	900,000.00	911,812.50	
1.875 T-NOTE 220531	200,000.00	201,703.12	
1.875 T-NOTE 220831	1,300,000.00	1,309,039.06	
1.875 T-NOTE 221031	1,400,000.00	1,408,203.12	
2 T-NOTE 200731	1,600,000.00	1,640,500.00	
2 T-NOTE 200930	1,200,000.00	1,230,187.50	
2 T-NOTE 201130	800,000.00	819,500.00	
2 T-NOTE 210228	800,000.00	819,312.50	
2 T-NOTE 210531	1,700,000.00	1,738,582.03	
2 T-NOTE 210831	1,500,000.00	1,531,699.21	
2 T-NOTE 211031	1,200,000.00	1,224,187.50	
2 T-NOTE 211115	1,400,000.00	1,427,781.25	
2 T-NOTE 220215	1,900,000.00	1,937,777.34	
2 T-NOTE 220731	1,800,000.00	1,827,984.37	
2 T-NOTE 221130	1,500,000.00	1,520,976.56	
2 T-NOTE 230215	3,100,000.00	3,142,625.00	
2 T-NOTE 250215	3,500,000.00	3,495,898.43	
2 T-NOTE 250815	3,900,000.00	3,887,507.80	
2.125 T-NOTE 200831	2,500,000.00	2,575,976.56	
2.125 T-NOTE 210131	100,000.00	103,062.50	
2.125 T-NOTE 210630	1,700,000.00	1,748,609.37	
2.125 T-NOTE 210815	2,100,000.00	2,160,539.06	
2.125 T-NOTE 210930	1,400,000.00	1,438,718.75	
2.125 T-NOTE 211231	1,900,000.00	1,950,023.43	
2.125 T-NOTE 220630	2,300,000.00	2,353,906.25	
2.125 T-NOTE 250515	3,700,000.00	3,731,507.81	
2.25 T-NOTE 171130	1,600,000.00	1,640,062.49	
2.25 T-NOTE 180731	1,200,000.00	1,237,921.87	
2.25 T-NOTE 210331	1,700,000.00	1,760,960.93	
2.25 T-NOTE 210430	1,600,000.00	1,657,375.00	
2.25 T-NOTE 210731	1,600,000.00	1,656,250.00	
2.25 T-NOTE 241115	3,200,000.00	3,267,250.00	
2.25 T-NOTE 251115	2,300,000.00	2,344,203.12	
2.375 T-NOTE 170731	2,100,000.00	2,149,218.75	
2.375 T-NOTE 180531	300,000.00	309,785.15	
2.375 T-NOTE 180630	700,000.00	723,378.90	
2.375 T-NOTE 201231	2,200,000.00	2,294,187.50	
2.375 T-NOTE 240815	3,200,000.00	3,301,750.00	
2.5 T-BOND 450215	2,100,000.00	1,964,648.43	
2.5 T-NOTE 170630	1,800,000.00	1,843,523.43	
2.5 T-NOTE 230815	2,600,000.00	2,720,656.25	
2.5 T-NOTE 240515	3,100,000.00	3,231,992.18	
2.625 T-NOTE 180131	1,000,000.00	1,034,296.87	
2.625 T-NOTE 180430	800,000.00	829,812.50	
2.625 T-NOTE 200815	2,900,000.00	3,053,609.37	

2.625 T-NOTE 201115	1,200,000.00	1,263,843.75
2.75 T-BOND 420815	1,600,000.00	1,592,250.00
2.75 T-BOND 421115	2,200,000.00	2,184,703.12
2.75 T-NOTE 170531	1,700,000.00	1,745,222.65
2.75 T-NOTE 171231	1,400,000.00	1,449,601.56
2.75 T-NOTE 180228	1,000,000.00	1,037,617.18
2.75 T-NOTE 190215	1,500,000.00	1,574,882.81
2.75 T-NOTE 231115	2,700,000.00	2,872,968.75
2.75 T-NOTE 240215	1,900,000.00	2,018,304.68
2.875 T-BOND 430515	3,400,000.00	3,452,062.50
2.875 T-BOND 450815	1,600,000.00	1,617,749.99
2.875 T-NOTE 180331	600,000.00	625,007.81
3 T-BOND 420515	500,000.00	523,046.87
3 T-BOND 441115	2,300,000.00	2,386,070.31
3 T-BOND 450515	2,100,000.00	2,176,945.31
3 T-BOND 451115	1,200,000.00	1,245,375.00
3 T-NOTE 170228	1,800,000.00	1,845,703.12
3.125 T-BOND 411115	600,000.00	644,156.25
3.125 T-BOND 420215	700,000.00	750,804.68
3.125 T-BOND 430215	2,700,000.00	2,881,828.12
3.125 T-BOND 440815	2,300,000.00	2,447,703.12
3.125 T-NOTE 170131	2,200,000.00	2,254,828.12
3.125 T-NOTE 170430	1,900,000.00	1,957,000.00
3.125 T-NOTE 190515	1,600,000.00	1,702,250.00
3.125 T-NOTE 210515	1,700,000.00	1,835,468.75
3.25 T-NOTE 161231	2,000,000.00	2,048,359.37
3.25 T-NOTE 170331	2,200,000.00	2,265,742.18
3.375 T-BOND 440515	2,800,000.00	3,126,156.25
3.375 T-NOTE 191115	1,000,000.00	1,078,359.37
3.5 T-BOND 390215	800,000.00	918,562.50
3.5 T-NOTE 180215	900,000.00	947,355.46
3.5 T-NOTE 200515	2,100,000.00	2,284,980.46
3.625 T-BOND 430815	1,400,000.00	1,640,078.12
3.625 T-BOND 440215	1,500,000.00	1,755,468.75
3.625 T-NOTE 190815	1,000,000.00	1,084,062.50
3.625 T-NOTE 200215	2,400,000.00	2,617,875.00
3.625 T-NOTE 210215	2,200,000.00	2,425,843.75
3.75 T-BOND 410815	900,000.00	1,071,984.37
3.75 T-BOND 431115	500,000.00	598,906.25
3.75 T-NOTE 181115	1,800,000.00	1,936,195.31
3.875 T-BOND 400815	1,100,000.00	1,332,718.75
3.875 T-NOTE 180515	1,600,000.00	1,708,250.00
4 T-NOTE 180815	1,300,000.00	1,400,800.78
4.25 T-BOND 390515	600,000.00	768,234.37
4.25 T-BOND 401115	900,000.00	1,152,773.43
4.25 T-NOTE 171115	1,800,000.00	1,909,054.68
4.375 T-BOND 380215	500,000.00	652,773.43
4.375 T-BOND 391115	600,000.00	781,593.75
4.375 T-BOND 400515	1,100,000.00	1,433,351.56
4.375 T-BOND 410515	800,000.00	1,045,625.00
4.5 T-BOND 360215	500,000.00	662,968.75
4.5 T-BOND 380515	500,000.00	664,140.62
4.5 T-BOND 390815	700,000.00	927,445.31
4.5 T-NOTE 170515	1,500,000.00	1,574,121.09
4.625 T-BOND 400215	1,000,000.00	1,348,671.87
4.625 T-NOTE 170215	2,100,000.00	2,188,183.59
4.75 T-BOND 410215	1,000,000.00	1,375,625.00
4.75 T-NOTE 170815	1,300,000.00	1,379,777.34
5 T-BOND 370515	400,000.00	566,187.50
5.25 T-BOND 281115	400,000.00	535,468.75
5.25 T-BOND 290215	400,000.00	537,062.50
5.375 T-BOND 310215	700,000.00	975,843.75
5.5 T-BOND 280815	200,000.00	272,484.37
6 T-BOND 260215	600,000.00	815,953.12
6.125 T-BOND 271115	200,000.00	283,109.37
6.25 T-BOND 230815	300,000.00	394,078.12
6.25 T-BOND 300515	600,000.00	892,546.87



	6.5 T-BOND 261115	300,000.00	428,343.75	
	8 T-BOND 211115	700,000.00	948,226.56	
	8.125 T-BOND 190815	300,000.00	372,679.68	
	8.75 T-BOND 170515	900,000.00	994,816.40	
	8.75 T-BOND 200815	700,000.00	926,843.75	
	8.875 T-BOND 190215	600,000.00	742,125.00	
	国債証券 小計	329,000,000.00	340,980,585.19 (39,911,777,496)	
	アメリカドル 小計	329,000,000.00	340,980,585.19 (39,911,777,496)	
	カナダドル			
国債証券	0.25 CAN GOVT 170501	700,000.00	699,433.00	
	0.75 CAN GOVT 200901	700,000.00	709,366.00	
	0.75 CAN GOVT 210301	200,000.00	201,980.00	
	1.25 CAN GOVT 170801	400,000.00	405,784.00	
	1.25 CAN GOVT 180201	400,000.00	407,820.00	
	1.25 CAN GOVT 180301	800,000.00	816,128.00	
	1.25 CAN GOVT 180901	500,000.00	512,340.00	
	1.5 CAN GOVT 170201	600,000.00	607,344.00	
	1.5 CAN GOVT 170301	900,000.00	911,853.00	
	1.5 CAN GOVT 170901	900,000.00	917,361.00	
	1.5 CAN GOVT 200301	500,000.00	522,525.00	
	1.5 CAN GOVT 230601	700,000.00	729,379.00	
	1.5 CAN GOVT 260601	300,000.00	306,318.00	
	1.75 CAN GOVT 190301	600,000.00	626,322.00	
	1.75 CAN GOVT 190901	500,000.00	524,555.00	
	2.25 CAN GOVT 250601	700,000.00	768,285.00	
	2.5 CAN GOVT 240601	750,000.00	838,837.50	
	2.75 CAN GOVT 220601	700,000.00	785,932.00	
	2.75 CAN GOVT 481201	350,000.00	411,523.00	
	2.75 CANADA GOVER 641201	200,000.00	249,160.00	
	3.25 CAN GOVT 210601	600,000.00	684,072.00	
	3.5 CAN GOVT 200601	700,000.00	793,513.00	
	3.5 CAN GOVT 451201	880,000.00	1,179,640.00	
	3.75 CAN GOVT 190601	900,000.00	1,002,294.00	
	4 CAN GOVT 170601	900,000.00	945,243.00	
	4 CAN GOVT 410601	850,000.00	1,189,235.00	
	4.25 CAN GOVT 180601	800,000.00	874,400.00	
	5 CAN GOVT 370601	700,000.00	1,072,057.00	
	5.75 CAN GOVT 290601	500,000.00	751,440.00	
	5.75 CAN GOVT 330601	700,000.00	1,110,543.00	
	8 CAN GOVT 270601	200,000.00	339,632.00	
	国債証券 小計	19,130,000.00	21,894,314.50 (1,757,894,511)	
	カナダドル 小計	19,130,000.00	21,894,314.50 (1,757,894,511)	
	オーストラリアドル			
国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	600,000.00	589,626.00	
	2.75 AUST GOVT 191021	700,000.00	719,103.00	
	2.75 AUST GOVT 240421	1,300,000.00	1,316,588.00	
	2.75 AUST GOVT 350621	250,000.00	232,925.00	
	3.25 AUST GOVT 181021	800,000.00	828,192.00	
	3.25 AUST GOVT 250421	1,300,000.00	1,364,571.00	
	3.25 AUST GOVT 290421	600,000.00	621,012.00	
	3.25 AUST GOVT 390621	250,000.00	247,727.50	
	3.75 AUST GOVT 370421	450,000.00	484,753.50	
	4.25 AUST GOVT 170721	1,000,000.00	1,033,360.00	
	4.25 AUST GOVT 260421	1,100,000.00	1,251,965.00	
	4.5 AUST GOVT 200415	1,200,000.00	1,320,120.00	
	4.5 AUST GOVT 330421	550,000.00	652,751.00	
	4.75 AUST GOVT 270421	1,100,000.00	1,309,154.00	
	5.25 AUST GOVT 190315	1,300,000.00	1,431,170.00	
	5.5 AUST GOVT 180121	1,100,000.00	1,176,109.00	
	5.5 AUST GOVT 230421	1,050,000.00	1,261,543.50	
	5.75 AUST GOVT 210515	1,200,000.00	1,413,996.00	
	5.75 AUST GOVT 220715	1,000,000.00	1,203,970.00	
	6 AUST GOVT 170215	900,000.00	937,944.00	

国債証券 小計		17,750,000.00	19,396,580.50 (1,558,515,243)
オーストラリアドル 小計		17,750,000.00	19,396,580.50 (1,558,515,243)
イギリスポンド			
国債証券	1 GILT 170907	1,600,000.00	1,614,640.00
	1.25 GILT 180722	1,600,000.00	1,626,560.00
	1.5 GILT 210122	400,000.00	407,440.00
	1.75 GILT 170122	500,000.00	506,925.00
	1.75 GILT 190722	1,500,000.00	1,548,675.00
	1.75 GILT 220907	1,300,000.00	1,336,465.00
	2 GILT 200722	1,500,000.00	1,565,850.00
	2 GILT 250907	1,100,000.00	1,132,945.00
	2.25 GILT 230907	1,100,000.00	1,164,075.00
	2.5 GILT 650722	300,000.00	315,255.00
	2.75 GILT 240907	1,100,000.00	1,205,380.00
	3.25 GILT 440122	1,250,000.00	1,446,687.50
	3.5 GILT 450122	1,100,000.00	1,334,575.00
	3.5 GILT 680722	1,100,000.00	1,489,290.00
	3.75 GILT 190907	800,000.00	885,520.00
	3.75 GILT 200907	1,100,000.00	1,240,195.00
	3.75 GILT 210907	1,100,000.00	1,257,685.00
	3.75 GILT 520722	700,000.00	936,495.00
	4 GILT 220307	700,000.00	817,985.00
	4 GILT 600122	550,000.00	804,017.50
	4.25 GILT 271207	500,000.00	630,125.00
	4.25 GILT 320607	1,000,000.00	1,288,050.00
	4.25 GILT 360307	1,150,000.00	1,501,037.50
	4.25 GILT 390907	700,000.00	928,235.00
	4.25 GILT 401207	900,000.00	1,204,065.00
	4.25 GILT 461207	1,000,000.00	1,395,850.00
	4.25 GILT 491207	800,000.00	1,146,160.00
	4.25 GILT 551207	750,000.00	1,126,012.50
	4.5 GILT 190307	1,000,000.00	1,120,200.00
	4.5 GILT 340907	1,200,000.00	1,605,420.00
	4.5 GILT 421207	1,000,000.00	1,405,150.00
	4.75 GILT 200307	700,000.00	811,090.00
	4.75 GILT 301207	1,000,000.00	1,346,500.00
4.75 GILT 381207	900,000.00	1,271,925.00	
5 GILT 180307	1,100,000.00	1,207,250.00	
5 GILT 250307	1,000,000.00	1,294,500.00	
6 GILT 281207	600,000.00	887,040.00	
8 GILT 210607	700,000.00	953,575.00	
8.75 GILT 170825	500,000.00	567,975.00	
国債証券 小計		36,900,000.00	44,326,820.00 (7,394,600,112)
イギリスポンド 小計		36,900,000.00	44,326,820.00 (7,394,600,112)
スイスフラン			
国債証券	2 SWISS GOVT 210428	180,000.00	205,659.00
	2.25 SWISS GOVT 200706	250,000.00	284,062.50
	3 SWISS GOVT 180108	360,000.00	387,882.00
	3 SWISS GOVT 190512	210,000.00	237,184.50
	4 SWISS GOVT 230211	210,000.00	276,864.00
	4 SWISS GOVT 280408	340,000.00	507,161.00
	4.25 SWISS GOVT 170605	300,000.00	321,195.00
国債証券 小計		1,850,000.00	2,220,008.00 (259,385,734)
スイスフラン 小計		1,850,000.00	2,220,008.00 (259,385,734)
シンガポールドル			
国債証券	0.5 SINGAPORGOVT 180401	200,000.00	196,880.00
	1.375 SINGAPORGOV 171001	130,000.00	130,582.40
	1.625 SINGAPORGOV 191001	110,000.00	109,808.60
	2 SINGAPORGOVT 200701	150,000.00	150,489.00
	2.25 SINGAPORGOVT 210601	300,000.00	301,590.00
	2.375 SINGAPORGOV 170401	300,000.00	305,190.00
	2.375 SINGAPORGOV 250601	100,000.00	99,572.00

	2.5 SINGAPORGOVT 190601	320,000.00	329,632.00	
	2.75 SINGAPORGOVT 230701	230,000.00	236,279.00	
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	270,000.00	266,328.00	
	2.875 SINGAPORGOVT 290701	100,000.00	102,351.00	
	2.875SINGAPORGOVT 300901	190,000.00	193,610.00	
	3 SINGAPORGOVT 240901	350,000.00	366,415.00	
	3.125SINGAPORGOVT 220901	230,000.00	242,420.00	
	3.25 SINGAPORGOVT 200901	220,000.00	232,716.00	
	3.375 SINGAPORGOVT 330901	130,000.00	141,284.00	
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	290,000.00	316,941.00	
	4 SINGAPORGOVT 180901	210,000.00	224,511.00	
	国債証券 小計	3,830,000.00	3,946,599.00 (320,858,498)	
	シンガポールドル 小計	3,830,000.00	3,946,599.00 (320,858,498)	
	マレーシアリンギット			
国債証券	3.26 MALAYSIAGOV 180301	400,000.00	400,624.00	
	3.314 MALAYSIA 171031	600,000.00	605,532.00	
	3.394 MALAYSIAGOV 170315	600,000.00	604,212.00	
	3.418MALAYSIAGOV 220815	500,000.00	481,950.00	
	3.48 MALAYSIAGOV 230315	800,000.00	764,504.00	
	3.492 MALAYSIAGOV 200331	700,000.00	698,397.00	
	3.502MALAYSIAGOV 270531	900,000.00	816,714.00	
	3.58 MALAYSIAGOV 180928	600,000.00	605,742.00	
	3.654 MALAYSIAGOV 191031	600,000.00	604,590.00	
	3.659 MALAYSIAGOV 201015	200,000.00	201,874.00	
	3.733 MALAYSIAGO 280615	100,000.00	91,812.00	
	3.795 MALAYSIAGOV 220930	500,000.00	494,300.00	
	3.814MALAYSIAGOV 170215	300,000.00	303,237.00	
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	200,000.00	178,854.00	
	3.889 MALAYSIAGO 200731	600,000.00	608,424.00	
	3.892 MALAYSIAGOV 270315	600,000.00	565,566.00	
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	500,000.00	491,385.00	
	4.012 MALAYSIAGOV 170915	800,000.00	815,800.00	
	4.048 MALAYSIA 210930	700,000.00	709,002.00	
	4.127 MALAYSIA 320415	300,000.00	279,699.00	
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	600,000.00	611,190.00	
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	500,000.00	498,205.00	
	4.24 MALAYSIAGOV 180207	800,000.00	817,128.00	
	4.378MALAYSIAGOV 191129	1,200,000.00	1,239,576.00	
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	400,000.00	398,688.00	
	4.498 MALAYSIAGOV 300415	600,000.00	592,350.00	
	4.935 MALAYSIAGOV 430930	400,000.00	403,452.00	
	5.734MALAYSIAGOV 190730	300,000.00	322,800.00	
	国債証券 小計	15,300,000.00	15,205,607.00 (403,556,809)	
	マレーシアリンギット 小計	15,300,000.00	15,205,607.00 (403,556,809)	
	スウェーデンクローネ			
国債証券	1 SWD GOVT 261112	2,000,000.00	2,000,180.00	
	1.5 SWD GOVT 231113	3,900,000.00	4,172,766.00	
	2.5 SWD GOVT 250512	2,500,000.00	2,890,400.00	
	3.5 SWD GOVT 220601	4,700,000.00	5,632,151.00	
	3.5 SWD GOVT 390330	2,300,000.00	3,017,577.00	
	3.75 SWD GOVT 170812	3,200,000.00	3,415,680.00	
	4.25 SWD GOVT 190312	4,700,000.00	5,377,928.00	
	5 SWD GOVT 201201	4,500,000.00	5,579,460.00	
	国債証券 小計	27,800,000.00	32,086,142.00 (437,334,115)	
	スウェーデンクローネ 小計	27,800,000.00	32,086,142.00 (437,334,115)	
	ノルウェークローネ			
国債証券	1.75 NORWE GOVT 250313	1,700,000.00	1,759,245.00	
	2 NORWE GOVT 230524	2,600,000.00	2,752,880.00	
	3 NORWE GOVT 240314	2,500,000.00	2,839,250.00	
	3.75 NORWE GOVT 210525	3,800,000.00	4,359,170.00	
	4.25 NORWE GOVT 170519	3,200,000.00	3,352,960.00	
	4.5 NORWE GOVT 190522	3,500,000.00	3,944,850.00	

国債証券 小計		17,300,000.00	19,008,355.00 (250,910,286)
ノルウェークローネ 小計		17,300,000.00	19,008,355.00 (250,910,286)
デンマーククローネ			
国債証券	1.5 DMK GOVT 231115	2,800,000.00	3,009,440.00
	1.75 DMK GOVT 251115	3,000,000.00	3,260,250.00
	3 DMK GOVT 211115	4,900,000.00	5,683,755.00
	4 DMK GOVT 171115	2,600,000.00	2,804,620.00
	4 DMK GOVT 191115	4,900,000.00	5,656,315.00
	4.5 DMK GOVT 391115	6,500,000.00	10,542,935.00
	7 DMK GOVT 241110	1,500,000.00	2,331,675.00
	国債証券 小計		26,200,000.00
デンマーククローネ 小計		26,200,000.00	33,288,990.00 (569,907,508)
メキシコペソ			
国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	13,000,000.00	16,541,980.00
	10 MEXICAN BONOS 361120	3,300,000.00	4,422,759.00
	4.75 MEXICAN BONO 180614	11,300,000.00	11,387,462.00
	5 MEXICAN BONOS 170615	4,600,000.00	4,670,702.00
	5 MEXICAN BONOS 191211	5,300,000.00	5,285,319.00
	5.75 MEXICAN BONO 260305	1,300,000.00	1,252,641.00
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	9,500,000.00	9,945,645.00
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	5,700,000.00	5,935,296.00
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	4,500,000.00	4,913,685.00
	7.75 MEXICAN BONO 171214	8,800,000.00	9,413,184.00
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7,100,000.00	7,804,249.00
	7.75 MEXICAN BONO 341123	3,800,000.00	4,148,118.00
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7,300,000.00	7,954,664.00
	8 MEXICAN BONOS 200611	6,400,000.00	7,089,152.00
	8 MEXICAN BONOS 231207	4,500,000.00	5,073,480.00
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	13,400,000.00	14,796,146.00
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	5,100,000.00	5,983,932.00
8.5 MEXICAN BONOS 381118	5,500,000.00	6,473,500.00	
国債証券 小計		120,400,000.00	133,091,914.00 (851,788,249)
メキシコペソ 小計		120,400,000.00	133,091,914.00 (851,788,249)
ポーランドズロチ			
国債証券	1.5 POLAND 200425	1,100,000.00	1,072,225.00
	2 POLAND 210425	1,000,000.00	979,800.00
	2.5 POLAND 180725	1,300,000.00	1,329,770.00
	2.5 POLAND 260725	400,000.00	376,300.00
	3.25 POLAND 190725	1,100,000.00	1,150,930.00
	3.25 POLAND 250725	1,500,000.00	1,532,475.00
	3.75 POLAND 180425	1,000,000.00	1,049,500.00
	4 POLAND 231025	1,400,000.00	1,515,710.00
	4.75 POLAND 170425	900,000.00	937,440.00
	5.25 POLAND 171025	1,400,000.00	1,491,560.00
	5.25 POLAND 201025	1,100,000.00	1,251,745.00
	5.5 POLAND 191025	1,300,000.00	1,469,455.00
	5.75 POLAND 211025	800,000.00	941,640.00
	5.75 POLAND 220923	1,100,000.00	1,310,980.00
	5.75 POLAND 290425	500,000.00	623,860.00
	POLAND 170725	300,000.00	293,640.00
国債証券 小計		16,200,000.00	17,327,030.00 (493,647,084)
ポーランドズロチ 小計		16,200,000.00	17,327,030.00 (493,647,084)
南アフリカランド			
国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	8,600,000.00	9,030,602.00
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	4,600,000.00	3,057,022.00
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	4,200,000.00	2,774,184.00
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	3,300,000.00	2,943,732.00
	7 SOUTH AFRICA 310228	5,000,000.00	3,800,750.00
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	3,400,000.00	3,177,980.00
7.75 SOUTH AFRICA 230228	2,900,000.00	2,624,413.00	

	8 SOUTH AFRICA 181221	2,400,000.00	2,339,856.00	
	8 SOUTH AFRICA 300131	4,400,000.00	3,712,280.00	
	8.25 SOUTH AFRICA 170915	2,900,000.00	2,886,863.00	
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	3,000,000.00	2,538,180.00	
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	4,000,000.00	3,380,400.00	
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	2,200,000.00	1,874,598.00	
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	5,100,000.00	4,342,956.00	
	8.875 SOUTH AFRIC 350228	800,000.00	706,784.00	
	国債証券 小計	56,800,000.00	49,190,600.00 (341,874,670)	
	南アフリカランド 小計	56,800,000.00	49,190,600.00 (341,874,670)	
	ユーロ			
国債証券	0 NETH GOVT 180415	400,000.00	402,860.00	
	0 O.A.T 180225	200,000.00	201,250.00	
	0 O.A.T 200525	900,000.00	901,125.00	
	0 OBL 200417	1,100,000.00	1,110,395.00	
	0 SCHATS 170310	800,000.00	803,560.00	
	0 SCHATS 170616	800,000.00	804,480.00	
	0 SCHATS 170915	300,000.00	301,995.00	
	0 SCHATS 171215	100,000.00	100,755.00	
	0.25 AUSTRIA GOVT 191018	200,000.00	203,120.00	
	0.25 ITALY GOVT 180515	500,000.00	502,400.00	
	0.25 NETH GOVT 200115	500,000.00	508,125.00	
	0.25 NETH GOVT 250715	600,000.00	577,320.00	
	0.25 O.A.T 201125	600,000.00	606,120.00	
	0.25 OBL 180413	1,000,000.00	1,014,300.00	
	0.25 OBL 191011	500,000.00	510,125.00	
	0.25 OBL 201016	700,000.00	713,615.00	
	0.25 SPAIN GOVT 180430	200,000.00	200,540.00	
	0.375 FINNISH GOV 200915	300,000.00	305,805.00	
	0.5 BUND 250215	1,300,000.00	1,310,530.00	
	0.5 NETH GOVT 170415	500,000.00	505,525.00	
	0.5 O.A.T 191125	1,300,000.00	1,329,900.00	
	0.5 O.A.T 250525	1,600,000.00	1,557,840.00	
	0.5 OBL 170407	1,000,000.00	1,011,000.00	
	0.5 OBL 171013	800,000.00	812,480.00	
	0.5 OBL 180223	1,100,000.00	1,120,625.00	
	0.5 OBL 190412	1,100,000.00	1,129,975.00	
	0.5 SPAIN GOVT 171031	800,000.00	806,720.00	
	0.65 ITALY GOVT 201101	300,000.00	301,230.00	
	0.7 ITALY GOVT 200501	700,000.00	707,560.00	
	0.75 FINNISH GOVT 310415	200,000.00	185,640.00	
	0.75 ITALY GOVT 180115	900,000.00	913,095.00	
	0.75 OBL 170224	1,300,000.00	1,316,575.00	
	0.8 BEL GOVT 250622	800,000.00	797,080.00	
	0.8 IRISH GOVT 220315	200,000.00	205,860.00	
	0.875 FINNISH GOV 250915	100,000.00	100,795.00	
	1 BTAN 170725	1,200,000.00	1,224,540.00	
	1 BUND 240815	1,000,000.00	1,057,300.00	
	1 BUND 250815	1,000,000.00	1,049,250.00	
	1 O.A.T 180525	1,700,000.00	1,750,915.00	
	1 O.A.T 181125	1,200,000.00	1,241,940.00	
	1 O.A.T 190525	1,300,000.00	1,350,505.00	
	1 O.A.T 251125	900,000.00	910,710.00	
	1 OBL 181012	1,000,000.00	1,037,700.00	
	1 OBL 190222	1,100,000.00	1,145,925.00	
	1.05 ITALY GOVT 191201	800,000.00	821,480.00	
	1.125 FINNISH GOV 180915	300,000.00	311,400.00	
	1.15 AUSTRIA GOVT 181019	400,000.00	415,880.00	
	1.15 SPAIN GOVT 200730	300,000.00	306,570.00	
	1.2 AUSTRIA GOVT 251020	300,000.00	311,790.00	
	1.25 BEL GOVT 180622	600,000.00	622,500.00	
	1.25 NETH GOVT 180115	1,000,000.00	1,032,000.00	
	1.25 NETH GOVT 190115	400,000.00	418,340.00	
	1.35 ITALY GOVT 220415	900,000.00	923,580.00	
	1.4 SPAIN GOVT 200131	1,400,000.00	1,449,000.00	

1.45 ITALY GOVT 220915	500,000.00	514,075.00	
1.5 BUND 220904	900,000.00	986,085.00	
1.5 BUND 230215	800,000.00	878,480.00	
1.5 BUND 230515	300,000.00	329,820.00	
1.5 BUND 240515	1,000,000.00	1,100,650.00	
1.5 FINNISH GOVT 230415	200,000.00	216,050.00	
1.5 ITALY GOVT 190801	1,000,000.00	1,043,300.00	
1.5 ITALY GOVT 250601	1,100,000.00	1,103,850.00	
1.5 O.A.T 310525	300,000.00	302,445.00	
1.6 SPAIN GOVT 250430	1,100,000.00	1,093,180.00	
1.625 FINNISH GOV 220915	300,000.00	327,225.00	
1.65 AUSTRIA GOVT 241021	700,000.00	762,580.00	
1.75 AUSTRIA GOVT 231020	300,000.00	330,180.00	
1.75 BTAN 170225	1,100,000.00	1,125,685.00	
1.75 BUND 220704	1,300,000.00	1,443,715.00	
1.75 BUND 240215	1,100,000.00	1,232,275.00	
1.75 NETH GOVT 230715	700,000.00	772,345.00	
1.75 O.A.T 230525	1,800,000.00	1,970,010.00	
1.75 O.A.T 241125	1,500,000.00	1,635,750.00	
1.875 FINNISH GOV 170415	300,000.00	308,565.00	
1.95 AUSTRIA GOVT 190618	500,000.00	536,825.00	
1.95 SPAIN GOVT 300730	500,000.00	479,275.00	
2 BUND 220104	1,000,000.00	1,120,350.00	
2 BUND 230815	1,000,000.00	1,137,550.00	
2 FINNISH GOVT 240415	200,000.00	223,380.00	
2 IRISH GOVT 450218	300,000.00	295,650.00	
2 ITALY GOVT 251201	600,000.00	624,060.00	
2 NETH GOVT 240715	900,000.00	1,013,220.00	
2.1 SPAIN GOVT 170430	1,400,000.00	1,437,520.00	
2.15 ITALY GOVT 211215	1,000,000.00	1,074,900.00	
2.15 SPAIN GOVT 251031	900,000.00	931,905.00	
2.25 BEL GOVT 230622	600,000.00	677,910.00	
2.25 BUND 200904	900,000.00	1,001,970.00	
2.25 BUND 210904	900,000.00	1,017,675.00	
2.25 NETH GOVT 220715	800,000.00	906,800.00	
2.25 O.A.T 221025	1,400,000.00	1,579,270.00	
2.25 O.A.T 240525	1,500,000.00	1,700,175.00	
2.4 AUSTRIA GOVT 340523	200,000.00	231,380.00	
2.4 IRISH GOVT 300515	400,000.00	443,860.00	
2.5 BUND 210104	1,000,000.00	1,131,100.00	
2.5 BUND 440704	1,000,000.00	1,292,850.00	
2.5 BUND 460815	700,000.00	907,865.00	
2.5 ITALY GOVT 190501	1,200,000.00	1,289,760.00	
2.5 ITALY GOVT 241201	1,100,000.00	1,198,505.00	
2.5 NETH GOVT 170115	700,000.00	720,195.00	
2.5 NETH GOVT 330115	500,000.00	600,400.00	
2.5 O.A.T 201025	2,200,000.00	2,459,490.00	
2.5 O.A.T 300525	1,800,000.00	2,068,740.00	
2.6 BEL GOVT 240622	1,000,000.00	1,159,900.00	
2.625 FINNISH GOV 420704	250,000.00	315,237.50	
2.75 FINNISH GOVT 280704	250,000.00	300,050.00	
2.75 NETH GOVT 470115	550,000.00	729,437.50	
2.75 O.A.T 271025	1,500,000.00	1,771,050.00	
2.75 SPAIN GOVT 190430	1,100,000.00	1,186,900.00	
2.75 SPAIN GOVT 241031	1,500,000.00	1,634,850.00	
3 BEL GOVT 190928	600,000.00	669,840.00	
3 BEL GOVT 340622	400,000.00	487,540.00	
3 BUND 200704	1,400,000.00	1,600,130.00	
3 O.A.T 220425	2,000,000.00	2,342,800.00	
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	350,000.00	472,465.00	
3.2 AUSTRIA GOVT 170220	600,000.00	623,280.00	
3.25 BUND 200104	1,200,000.00	1,367,400.00	
3.25 BUND 210704	900,000.00	1,063,890.00	
3.25 BUND 420704	650,000.00	941,850.00	
3.25 ITALY GOVT 460901	700,000.00	790,160.00	
3.25 NETH GOVT 210715	800,000.00	940,760.00	
3.25 O.A.T 211025	2,100,000.00	2,472,015.00	

3.25 O.A.T 450525	850,000.00	1,105,850.00	
3.375 FINNISH GOV 200415	300,000.00	344,370.00	
3.4 AUSTRIA GOVT 221122	400,000.00	484,260.00	
3.4 IRISH GOVT 240318	400,000.00	481,800.00	
3.5 AUSTRIA GOVT 210915	800,000.00	954,160.00	
3.5 BEL GOVT 170628	700,000.00	739,095.00	
3.5 BUND 190704	1,200,000.00	1,358,880.00	
3.5 FINNISH GOVT 210415	300,000.00	354,525.00	
3.5 ITALY GOVT 171101	1,400,000.00	1,487,780.00	
3.5 ITALY GOVT 180601	1,200,000.00	1,297,740.00	
3.5 ITALY GOVT 181201	1,200,000.00	1,316,580.00	
3.5 ITALY GOVT 300301	1,000,000.00	1,187,550.00	
3.5 NETH GOVT 200715	900,000.00	1,045,845.00	
3.5 O.A.T 200425	1,800,000.00	2,072,790.00	
3.5 O.A.T 260425	2,000,000.00	2,507,900.00	
3.65 AUSTRIA GOVT 220420	500,000.00	607,625.00	
3.75 BEL GOVT 200928	1,000,000.00	1,176,900.00	
3.75 BEL GOVT 450622	500,000.00	707,075.00	
3.75 BUND 170104	700,000.00	728,175.00	
3.75 BUND 190104	900,000.00	1,009,755.00	
3.75 ITALY GOVT 210301	900,000.00	1,040,310.00	
3.75 ITALY GOVT 210501	1,000,000.00	1,158,600.00	
3.75 ITALY GOVT 210801	1,700,000.00	1,975,910.00	
3.75 ITALY GOVT 240901	900,000.00	1,071,315.00	
3.75 NETH GOVT 230115	800,000.00	994,080.00	
3.75 NETH GOVT 420115	800,000.00	1,221,760.00	
3.75 O.A.T 170425	1,700,000.00	1,788,825.00	
3.75 O.A.T 191025	1,800,000.00	2,062,530.00	
3.75 O.A.T 210425	1,900,000.00	2,265,370.00	
3.75 SPAIN GOVT 181031	1,100,000.00	1,208,845.00	
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	250,000.00	413,100.00	
3.8 SPAIN GOVT 170131	800,000.00	831,720.00	
3.8 SPAIN GOVT 240430	1,100,000.00	1,289,255.00	
3.875 FINNISH GOVT170915	300,000.00	321,270.00	
3.9 AUSTRIA GOVT 200715	800,000.00	942,920.00	
3.9 IRISH GOVT 230320	300,000.00	370,350.00	
4 BEL GOVT 170328	600,000.00	631,350.00	
4 BEL GOVT 180328	600,000.00	656,940.00	
4 BEL GOVT 190328	700,000.00	794,710.00	
4 BEL GOVT 220328	800,000.00	985,720.00	
4 BEL GOVT 320328	400,000.00	543,400.00	
4 BUND 180104	1,100,000.00	1,195,260.00	
4 BUND 370104	1,400,000.00	2,129,820.00	
4 FINNISH GOVT 250704	350,000.00	454,877.50	
4 ITALY GOVT 170201	1,400,000.00	1,459,080.00	
4 ITALY GOVT 200901	1,200,000.00	1,391,220.00	
4 ITALY GOVT 370201	1,500,000.00	1,891,200.00	
4 NETH GOVT 180715	1,000,000.00	1,107,850.00	
4 NETH GOVT 190715	1,400,000.00	1,606,850.00	
4 NETH GOVT 370115	750,000.00	1,124,400.00	
4 O.A.T 180425	1,800,000.00	1,975,680.00	
4 O.A.T 381025	1,300,000.00	1,853,735.00	
4 O.A.T 550425	800,000.00	1,228,400.00	
4 O.A.T 600425	600,000.00	932,700.00	
4 SPAIN GOVT 200430	1,400,000.00	1,600,130.00	
4.1 SPAIN GOVT 180730	1,300,000.00	1,429,350.00	
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	650,000.00	962,520.00	
4.2 SPAIN GOVT 370131	800,000.00	989,440.00	
4.25 BEL GOVT 210928	800,000.00	986,400.00	
4.25 BEL GOVT 220928	800,000.00	1,008,400.00	
4.25 BEL GOVT 410328	900,000.00	1,348,155.00	
4.25 BUND 170704	1,000,000.00	1,068,050.00	
4.25 BUND 180704	1,000,000.00	1,114,150.00	
4.25 BUND 390704	650,000.00	1,051,537.50	
4.25 ITALY GOVT 190201	1,400,000.00	1,574,090.00	
4.25 ITALY GOVT 190901	1,100,000.00	1,256,805.00	
4.25 ITALY GOVT 200301	1,400,000.00	1,620,850.00	

4.25 O.A.T 171025	2,300,000.00	2,487,105.00	
4.25 O.A.T 181025	1,500,000.00	1,686,900.00	
4.25 O.A.T 190425	1,600,000.00	1,831,680.00	
4.25 O.A.T 231025	2,000,000.00	2,574,400.00	
4.3 AUSTRIA GOVT 170915	500,000.00	538,650.00	
4.3 SPAIN GOVT 191031	1,100,000.00	1,258,345.00	
4.35 AUSTRIA GOVT 190315	600,000.00	686,910.00	
4.375 FINNISH GOV 190704	300,000.00	347,745.00	
4.4 IRISH GOVT 190618	400,000.00	460,820.00	
4.4 SPAIN GOVT 231031	900,000.00	1,096,740.00	
4.5 BEL GOVT 260328	500,000.00	674,900.00	
4.5 IRISH GOVT 181018	500,000.00	564,150.00	
4.5 IRISH GOVT 200418	600,000.00	712,980.00	
4.5 ITALY GOVT 180201	1,800,000.00	1,964,070.00	
4.5 ITALY GOVT 180801	1,100,000.00	1,223,530.00	
4.5 ITALY GOVT 190301	800,000.00	907,840.00	
4.5 ITALY GOVT 200201	1,400,000.00	1,631,700.00	
4.5 ITALY GOVT 230501	1,000,000.00	1,235,000.00	
4.5 ITALY GOVT 240301	1,200,000.00	1,494,300.00	
4.5 ITALY GOVT 260301	1,200,000.00	1,528,080.00	
4.5 NETH GOVT 170715	800,000.00	858,320.00	
4.5 O.A.T 410425	1,350,000.00	2,092,837.50	
4.5 SPAIN GOVT 180131	1,400,000.00	1,525,300.00	
4.6 SPAIN GOVT 190730	1,000,000.00	1,148,000.00	
4.65 AUSTRIA GOVT 180115	700,000.00	769,755.00	
4.65 SPAIN GOVT 250730	1,000,000.00	1,256,450.00	
4.7 SPAIN GOVT 410730	800,000.00	1,064,440.00	
4.75 BUND 280704	600,000.00	888,630.00	
4.75 BUND 340704	1,050,000.00	1,694,385.00	
4.75 BUND 400704	700,000.00	1,220,205.00	
4.75 ITALY GOVT 170501	700,000.00	742,980.00	
4.75 ITALY GOVT 170601	500,000.00	532,625.00	
4.75 ITALY GOVT 210901	1,500,000.00	1,827,075.00	
4.75 ITALY GOVT 230801	1,400,000.00	1,761,480.00	
4.75 ITALY GOVT 280901	1,000,000.00	1,322,650.00	
4.75 ITALY GOVT 440901	750,000.00	1,070,250.00	
4.75 O.A.T 350425	1,400,000.00	2,130,100.00	
4.8 SPAIN GOVT 240131	800,000.00	1,000,360.00	
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	400,000.00	557,220.00	
4.85 SPAIN GOVT 201031	1,000,000.00	1,193,400.00	
4.9 SPAIN GOVT 400730	750,000.00	1,022,737.50	
5 BEL GOVT 350328	1,100,000.00	1,711,765.00	
5 IRISH GOVT 201018	400,000.00	492,280.00	
5 ITALY GOVT 220301	1,100,000.00	1,368,510.00	
5 ITALY GOVT 250301	1,200,000.00	1,562,460.00	
5 ITALY GOVT 340801	1,700,000.00	2,402,695.00	
5 ITALY GOVT 390801	900,000.00	1,300,770.00	
5 ITALY GOVT 400901	1,150,000.00	1,656,115.00	
5.15 SPAIN GOVT 281031	800,000.00	1,067,640.00	
5.15 SPAIN GOVT 441031	550,000.00	787,105.00	
5.25 ITALY GOVT 170801	1,400,000.00	1,513,610.00	
5.25 ITALY GOVT 291101	1,600,000.00	2,232,160.00	
5.4 IRISH GOVT 250313	600,000.00	830,580.00	
5.4 SPAIN GOVT 230131	1,100,000.00	1,404,535.00	
5.5 BEL GOVT 170928	400,000.00	439,780.00	
5.5 BEL GOVT 280328	1,000,000.00	1,493,650.00	
5.5 BUND 310104	900,000.00	1,477,350.00	
5.5 IRISH GOVT 171018	400,000.00	440,520.00	
5.5 ITALY GOVT 220901	1,000,000.00	1,287,550.00	
5.5 ITALY GOVT 221101	1,000,000.00	1,290,500.00	
5.5 NETH GOVT 280115	700,000.00	1,068,725.00	
5.5 O.A.T 290425	1,400,000.00	2,131,990.00	
5.5 SPAIN GOVT 170730	1,100,000.00	1,192,235.00	
5.5 SPAIN GOVT 210430	1,200,000.00	1,488,300.00	
5.625 BUND 280104	700,000.00	1,098,615.00	
5.75 ITALY GOVT 330201	1,000,000.00	1,508,150.00	
5.75 O.A.T 321025	1,450,000.00	2,374,157.50	



5.75 SPAIN GOVT 320730	900,000.00	1,310,490.00	
5.85 SPAIN GOVT 220131	1,200,000.00	1,539,840.00	
5.9 IRISH GOVT 191018	400,000.00	488,200.00	
5.9 SPAIN GOVT 260730	600,000.00	829,710.00	
6 ITALY GOVT 310501	1,200,000.00	1,815,480.00	
6 O.A.T 251025	1,200,000.00	1,790,400.00	
6 SPAIN GOVT 290131	1,200,000.00	1,722,360.00	
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	300,000.00	473,430.00	
6.25 BUND 240104	900,000.00	1,329,210.00	
6.25 BUND 300104	400,000.00	687,940.00	
6.5 BUND 270704	600,000.00	991,290.00	
6.5 ITALY GOVT 271101	800,000.00	1,197,320.00	
7.25 ITALY GOVT 261101	700,000.00	1,084,965.00	
8.5 O.A.T 191025	600,000.00	795,150.00	
8.5 O.A.T 230425	600,000.00	949,350.00	
9 ITALY GOVT 231101	600,000.00	945,810.00	
国債証券 小計	243,900,000.00	289,765,667.50 (37,014,666,366)	
ユーロ 小計	243,900,000.00	289,765,667.50 (37,014,666,366)	
合計		91,566,716,681 (91,566,716,681)	

(注1) 通貨の種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 209銘柄	100.00%	43.59%
カナダドル	国債証券 31銘柄	100.00%	1.92%
オーストラリアドル	国債証券 20銘柄	100.00%	1.70%
イギリスポンド	国債証券 39銘柄	100.00%	8.08%
スイスフラン	国債証券 7銘柄	100.00%	0.28%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.00%	0.35%
マレーシアリングgit	国債証券 28銘柄	100.00%	0.44%
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 6銘柄	100.00%	0.27%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.00%	0.62%
メキシコペソ	国債証券 18銘柄	100.00%	0.93%
ポーランドズロチ	国債証券 16銘柄	100.00%	0.54%
南アフリカランド	国債証券 15銘柄	100.00%	0.37%
ユーロ	国債証券 271銘柄	100.00%	40.42%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

2【ファンドの現況】  
【純資産額計算書】平成28年1月29日現在  
(単位:円)

資産総額	1,269,795,813
負債総額	325,455
純資産総額( - )	1,269,470,358
発行済口数	1,290,781,443 口
1口当たり純資産価額( / )	0.9835 ( 1万口当たり 9,835 )

## &lt;参考&gt;

「三菱UFJ 外国債券マザーファンド」の現況  
純資産額計算書平成28年1月29日現在  
(単位:円)

資産総額	95,893,747,115
負債総額	1,014,966,998
純資産総額( - )	94,878,780,117
発行済口数	34,529,735,242 口
1口当たり純資産価額( / )	2.7477 ( 1万口当たり 27,477 )

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### （1）名義書換

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

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

### （2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

### （3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

### （4）受益権の譲渡

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

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

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

### （5）受益権の譲渡の対抗要件

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

### （6）受益権の再分割

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

### （7）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

報告書代替書面における「委託会社等の概況」の記載のとおりです。

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

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

報告書代替書面における「事業の内容及び営業の概況」の記載のとおりです。

#### 3【委託会社等の経理状況】

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

##### （1）【貸借対照表】

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

##### （2）【損益計算書】

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

##### （3）【株主資本等変動計算書】

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

通常の実行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27年9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27年9月末現在)	事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
カブドットコム証券株式会社	7,196 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。
株式会社SBI証券	47,937 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
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。
フィデリティ証券株式会社	7,007 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

### 2【関係業務の概要】

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

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

### 3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（平成28年1月末現在）

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

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

### 第3【参考情報】

1 当特定期間において、次の書類を関東財務局長に提出しております。

平成27年11月2日 臨時報告書

平成27年10月16日 有価証券報告書、有価証券届出書の訂正届出書

平成27年8月3日 臨時報告書

2 その他

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

独立監査人の監査報告書

平成28年2月25日

三菱UFJ国際投信株式会社  
取締役会御中

PwCあらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印  
業務執行社員指定社員 公認会計士 大畑 茂 印  
業務執行社員

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世界国債インデックスファンド（毎月分配型）の平成27年7月18日から平成28年1月18日までの特定期間の財務諸表、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世界国債インデックスファンド（毎月分配型）の平成28年1月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定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。