

【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21年10月16日
【計算期間】	第5特定期間（自平成21年1月20日 至平成21年7月17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投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 後藤 俊夫
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号
【事務連絡者氏名】	荻久保 育子
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号
【電話番号】	03-6250-4740
【縦覧に供する場所】	該当ありません

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、シティグループ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、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	年1回 年2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
大型株 中小型株	年4回 年6回	日本 北米 欧州	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ()	(隔月) 年12回 (毎月) 日々 その他 ()	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			その他 (シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース))	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型 その他 ()
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (債券 一般 ク レジット属性 (高格付債)))						
資産複合 ()						

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

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

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ず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）	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）	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。

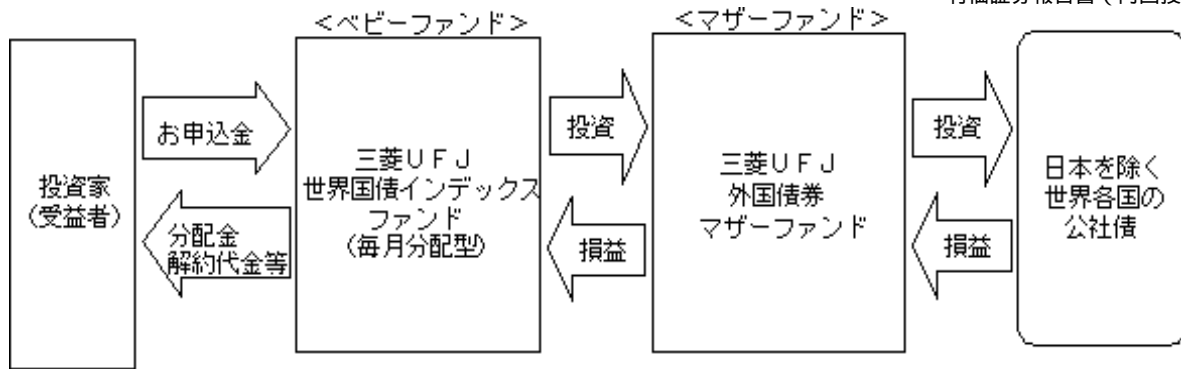
属性区分の定義

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	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。

運用はファミリーファンド方式により行い、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。)への投資を通じて、日本を除く世界各国の公社債への実質的投資を行います。なお、当ファンドで直接投資をすることがあります。ファミリーファンド方式とは、投資家(受益者)から投資された資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、実質的な運用を行う仕組みのことをいいます。



<ファンドの特色>

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、シティグループ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。

1. 日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

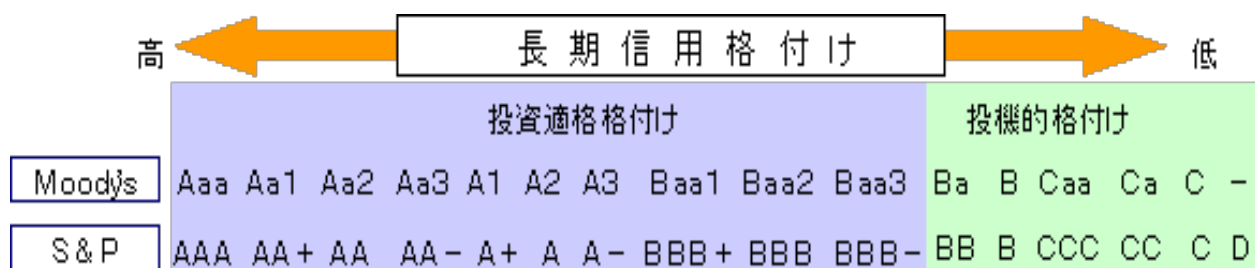
運用にあたっては、三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、公社債、短期金融商品に直接投資することがあります。

2. シティグループ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。

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）とは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し指数化した債券インデックスです。当該指数は、以下の22カ国で構成されています（2009年1月末現在）。ただし、構成国は変わる可能性があります。



当ファンドが連動を目指すシティグループ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、したがって当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、発行されている債券の元本返済・利払いの確実性を評価して、その度合いについて一定の記号を用いてランク付けしたものです。

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

3. 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(17日が休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、信託約款の運用の基本方針に定める「収益分配方針」に基づいて分配を行います。分配対象収益が少額の場合には分配を行わないこともあります。

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。

4. 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。

外貨建資産への実質投資割合は原則として高位を保ち為替ヘッジを行いませんので、為替変動リスクがあります。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、投資元金を割り込むことがあります。

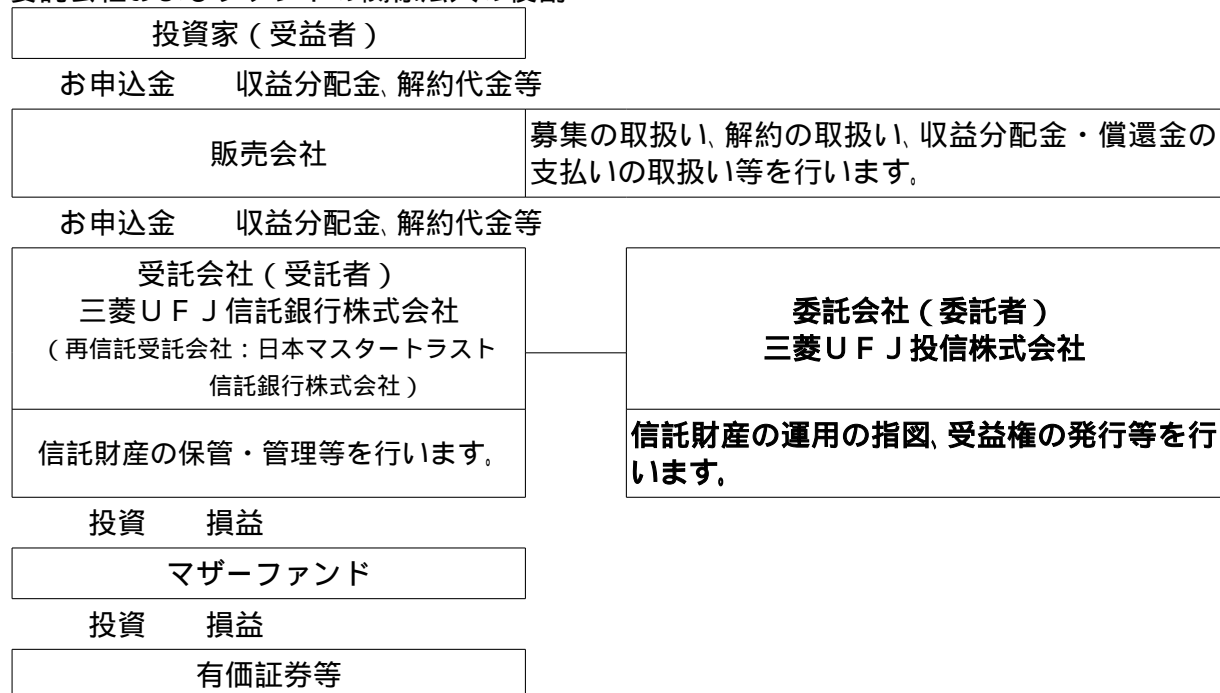
ただし、市況動向の判断により、為替ヘッジを行う場合があります。

市況動向とは、天災地変・テロ・戦争等による市場の急変時等を想定しています。

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) 【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割



委託会社と関係法人との契約の概要

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

委託会社の概況

・資本金

2,000百万円（平成21年8月末現在）

・沿革

- 平成9年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
- 平成16年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
- 平成17年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更

・大株主の状況（平成21年8月末現在）

株主名	住所	所有株式数	所有比率
株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	68,253株	55.0%
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	37,230株	30.0%
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	18,615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、シティグループ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、)

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券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

13. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券

14. 投資証券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。)

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（シティグループ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（シティグループ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。

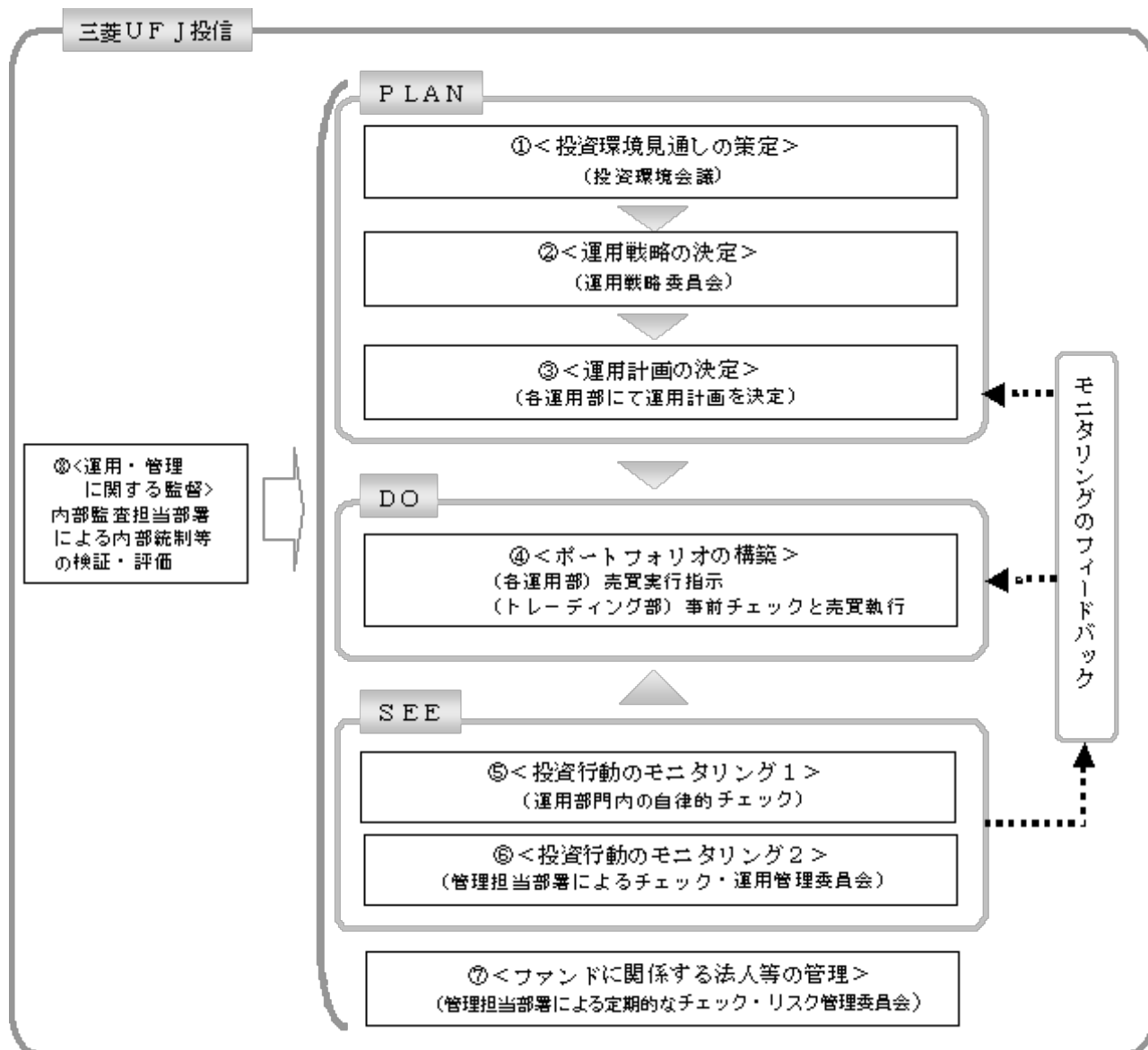
同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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。

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。

(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ファンド毎の運用戦略を決定します。

運用計画の決定

で決定されたファンド毎の運用戦略に基づいて、各運用部は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戦略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。

ファンドに関する法人等の管理

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(5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平成21年10月17日現在のものであり、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。

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。

<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。

・デリバティブ取引の投資制限

委託会社は、運用財産に関し、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あらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該運用財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。)を行い、または継続することを内容とした運用を行うことをしないものとします。

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

当ファンドへの投資にあたっては、主に以下のリスクを伴います。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。

市場リスク

(価格変動リスク)

当ファンドは、公社債を実質的な主要投資対象とし、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に概ね連動することをめざしていることから、公社債の投資に係る価格変動リスクを伴います。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・シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）が下落した場合には基準価額の下落により損失を被り、投資元金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すので、為替変動の影響を受けます。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、投資元金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、投資元金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、投資元金を割り込むことがあります。

留意事項

- ・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。
- ・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、シティグループ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。
- ・当ファンドは、原則として毎期収益分配を行う方針ですが、毎期一定水準の収益分配金の支払いを保証するものではなく、収益分配金額は運用実績に応じて変動します。なお、分配対象収益が少額の場合には、収益分配を行わないことがあります。

(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おります。

各投資リスクに関する管理体制は以下の通りです。

市場リスク

(価格変動リスク・為替変動リスク)

市場リスクは、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、市場リスクは、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、市場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。

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0.7875% (税抜 年0.75%)

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0.42% (税抜 年0.4%)	年0.315% (税抜 年0.3%)	年0.0525% (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。

委託会社は、監査報酬等の支払いを信託財産のためにを行い委託会社が支払った金額を信託財産から受けることができます。この場合、委託会社は、信託財産のために支払った金額を受ける際に、あらかじめ受領する金額に上限を付することができます。また、委託会社は、実際に支払う金額を受ける代わりに、かかる監査報酬等の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、実際の費用額にかかわらず固定率あるいは固定金額にて信託財産からその支払いを受けることができます。

監査報酬等の上限、固定率または固定金額を定める場合、委託会社は、信託財産の規模等を考慮して、信託の設定時または期中に、あらかじめ委託会社が定めた範囲内でかかる上限、固定率または固定金額を変更することができます。

監査報酬等の固定率または固定金額を定める場合、かかる費用の額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に応じて計算し、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、以下のものが含まれます。

- ・ 有価証券の売買の際に発生する証券取引に伴う手数料
- ・ 先物取引・オプション取引に要する費用
- ・ 有価証券の保管に要する費用

（＊）「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。

（５）【課税上の取扱い】

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。特別分配金（受益者の元本の一部払戻しに相当する部分）は課税されません。

原則として、10%（所得税7%および地方税3%）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・申告分離課税を選択することもできます。申告分離課税を選択した場合、10%（所得税7%および地方税3%）の税率となります。

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。

10%（所得税7%および地方税3%）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、10%（所得税7%および地方税3%）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。

平成23年12月31日まで適用される税率です。平成24年以降は、20%（所得税15%および地方税5%）の税率となる予定です。

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7%（所得税7%）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。

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。

平成23年12月31日まで適用される税率です。平成24年以降は、15%（所得税15%）の税率となる予定です。

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特別分配金となり、当該収益分配金から当該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。

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、税務署等にご確認ください。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成21年7月31日現在
(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	1,775,304,636	100.00
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		49,090	0.00
純資産総額		1,775,353,726	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21年7月31日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数 (口)	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	三菱UFJ 外国債券マザーファンド	親投資信託 受益証券		950,682,573	1.8311 1.8674	1,740,794,860 1,775,304,636		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21年7月31日現在

種類/業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	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21年7月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額	基準価額 (1万口当たりの純資産価額)
第1計算期間末日 (平成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)

	純資産総額	基準価額 (1万口当たりの純資産価額)
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)
平成20年 7月末日	1,977,947,619	9,848
8月末日	1,947,325,520	9,663
9月末日	1,864,158,542	9,073
10月末日	1,587,119,022	7,963
11月末日	1,599,465,098	7,949
12月末日	1,658,046,992	8,080
平成21年 1月末日	1,536,813,141	7,353
2月末日	1,670,312,086	7,943
3月末日	1,745,747,226	8,242
4月末日	1,755,268,415	8,241
5月末日	1,772,923,893	8,250
6月末日	1,777,769,175	8,356
7月末日	1,775,353,726	8,314

【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

	1万口当たりの分配金
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

【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

（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（分配落ちの額、以下「前期末基準価額」）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数。

< 参考 >

「三菱UFJ 外国債券マザーファンド」

(1) 投資状況

平成21年7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	74,096,633,668	30.66
	ドイツ	28,480,715,420	11.79
	イタリア	28,458,633,773	11.78
	フランス	25,755,204,638	10.66
	イギリス	19,227,804,313	7.96
	スペイン	11,334,708,429	4.69
	ベルギー	8,106,897,401	3.35
	ギリシャ	6,776,499,956	2.80
	オランダ	6,714,351,894	2.78
	カナダ	6,137,557,312	2.54
	オーストリア	4,529,696,756	1.87
	ポルトガル	2,888,661,251	1.20
	ポーランド	2,120,745,686	0.88
	デンマーク	2,035,458,829	0.84
	スイス	1,725,713,452	0.71
	スウェーデン	1,666,323,276	0.69
	フィンランド	1,649,947,434	0.68
	オーストラリア	1,482,463,459	0.61
	マレーシア	1,257,280,597	0.52
アイルランド	1,211,737,200	0.50	
シンガポール	1,011,264,022	0.42	
ノルウェー	705,329,914	0.29	
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		4,278,261,992	1.78
純資産総額		241,651,890,672	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21年7月31日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	券面総額	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
アメリカ	5.75 T-NOTE 100815	国債証券		19,600,000.00	10,162.78 10,052.6926	1,991,905,174 1,970,327,760	5.750000 2010/08/15	0.82
フランス	5.5 O.A.T 101025	国債証券		11,400,000.00	14,284.11 14,206.0786	1,628,388,745 1,619,492,960	5.500000 2010/10/25	0.67
アメリカ	5 T-NOTE 110215	国債証券		15,500,000.00	10,242.14 10,145.1792	1,587,531,845 1,572,502,778	5.000000 2011/02/15	0.65
ドイツ	5 BUND 110704	国債証券		9,000,000.00	14,444.88 14,366.5848	1,300,039,839 1,292,992,633	5.000000 2011/07/04	0.54
アメリカ	3.75 T-NOTE 181115	国債証券		13,400,000.00	9,945.28 9,633.5196	1,332,668,713 1,290,891,638	3.750000 2018/11/15	0.53
アメリカ	2.75 T-NOTE 190215	国債証券		14,300,000.00	9,153.01 8,865.2845	1,308,881,766 1,267,735,686	2.750000 2019/02/15	0.52
イギリス	5 GILT 120307	国債証券		7,300,000.00	17,085.71 16,842.2381	1,247,256,939 1,229,483,384	5.000000 2012/03/07	0.51
イタリア	6 ITALY GOVT 310501	国債証券		7,600,000.00	14,631.22 15,111.5328	1,111,973,100 1,148,476,492	6.000000 2031/05/01	0.48
イタリア	5 ITALY GOVT 120201	国債証券		7,900,000.00	14,436.14 14,436.1420	1,140,455,218 1,140,455,218	5.000000 2012/02/01	0.47
フランス	6.5 O.A.T 110425	国債証券		7,500,000.00	14,737.51 14,643.3336	1,105,313,370 1,098,250,020	6.500000 2011/04/25	0.45
イタリア	6.5 ITALY GOVT 271101	国債証券		6,800,000.00	15,564.93 15,878.4108	1,058,415,416 1,079,731,934	6.500000 2027/11/01	0.45
ドイツ	5.25 BUND 100704	国債証券		7,700,000.00	14,090.37 14,008.5738	1,084,958,813 1,078,660,188	5.250000 2010/07/04	0.45
アメリカ	4.875 T-NOTE 110731	国債証券		10,500,000.00	10,348.05 10,236.9199	1,086,545,561 1,074,876,596	4.875000 2011/07/31	0.44

国/ 地域	銘柄	種類	業種	券面総額	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)	償還期限 (年/月/日)	
ドイツ	5.25 BUND 110104	国債証券		7,500,000.00	14,325.14 14,254.1093	1,074,385,987 1,069,058,203	5.250000 2011/01/04	0.44
ドイツ	5 BUND 120104	国債証券		7,100,000.00	14,600.95 14,506.5064	1,036,667,698 1,029,961,955	5.000000 2012/01/04	0.43
イギリス	4.5 GILT 130307	国債証券		6,100,000.00	16,983.21 16,691.4865	1,035,975,993 1,018,180,676	4.500000 2013/03/07	0.42
フランス	4.25 O.A.T 190425	国債証券		7,200,000.00	13,911.65 14,130.7362	1,001,638,864 1,017,413,006	4.250000 2019/04/25	0.42
イタリア	3.75 ITALY GOVT 160801	国債証券		7,400,000.00	13,522.61 13,702.8990	1,000,673,539 1,014,014,526	3.750000 2016/08/01	0.42
ドイツ	5 BUND 120704	国債証券		6,900,000.00	14,701.18 14,617.3673	1,014,381,820 1,008,598,349	5.000000 2012/07/04	0.42
イギリス	4.25 GILT 110307	国債証券		6,000,000.00	16,628.41 16,492.7971	997,704,630 989,567,826	4.250000 2011/03/07	0.41
ドイツ	3.5 BUND 160104	国債証券		7,100,000.00	13,874.40 13,895.1566	985,082,506 986,556,122	3.500000 2016/01/04	0.41
イタリア	5.25 ITALY GOVT 291101	国債証券		7,000,000.00	13,604.68 13,989.4692	952,327,936 979,262,844	5.250000 2029/11/01	0.41
ドイツ	3.5 OBL 110408	国債証券		7,000,000.00	13,986.24 13,959.1977	979,036,816 977,143,839	3.500000 2011/04/08	0.40
アメリカ	3.125 T-NOTE 190515	国債証券		10,300,000.00	9,220.37 9,142.7442	949,698,639 941,702,654	3.125000 2019/05/15	0.39
ドイツ	4.25 BUND 140704	国債証券		6,500,000.00	14,526.55 14,483.3655	944,225,937 941,418,760	4.250000 2014/07/04	0.39
イギリス	4.5 GILT 190307	国債証券		5,700,000.00	16,980.71 16,478.6050	967,900,904 939,280,485	4.500000 2019/03/07	0.39
イタリア	4.25 ITALY GOVT 130801	国債証券		6,500,000.00	14,119.97 14,228.9504	917,798,245 924,881,776	4.250000 2013/08/01	0.38
イタリア	3.75 ITALY GOVT 150801	国債証券		6,700,000.00	13,655.97 13,784.9684	914,950,571 923,592,882	3.750000 2015/08/01	0.38
イタリア	4.25 ITALY GOVT 140801	国債証券		6,400,000.00	14,109.20 14,231.6412	902,989,427 910,825,036	4.250000 2014/08/01	0.38
イギリス	4.75 GILT 381207	国債証券		5,600,000.00	16,723.02 16,169.2172	936,489,372 905,476,164	4.750000 2038/12/07	0.37

(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21年7月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	98.23
合計	98.23

(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。

第二部【ファンドの詳細情報】

第1【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

第2【手続等】

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投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。 ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/
申込手数料	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には販売会社により異なる場合がありますので、販売会社にご確認ください。 取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。
申込受付時間	原則、午後3時（半日営業日は午前11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）を当日の申込みとします。当該時刻を過ぎての申込みは、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投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/
支払開始日	原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。
解約請求受付時間	原則、午後3時(半日営業日は午前11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。

第3【管理及び運営】

1【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出方法	$\text{基準価額} = \text{信託財産の純資産総額} \div \text{受益権総口数}$ <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。 (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。 (主な評価方法) マザーファンド：計算日における基準価額で評価します。 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。 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。 外貨建資産：原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円換算します。 外国為替予約取引：原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。</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いただけます。</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.mufig.jp/</p>
-----------	---

(2) 【保管】

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

(3) 【信託期間】

信託期間	<p>平成19年4月19日から無期限</p> <p>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。</p>
------	--

(4) 【計算期間】

計算期間	<p>原則として、毎月18日から翌月17日まで</p> <p>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。</p>
------	--

(5) 【その他】

ファンドの償還条件等	<p>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)</p> <ul style="list-style-type: none"> ・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 <p>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。</p> <p>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。</p>
信託約款の変更	<p>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。</p> <p>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。</p>
ファンドの償還等に関する開示方法	<p>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。この公告は、日本経済新聞に掲載します。</p>

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。)。この公告は、日本経済新聞に掲載します。
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。
運用報告書の作成	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、運用経過、信託財産の内容および有価証券の売買状況などを記載した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。受託会社が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。

2【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	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。 「分配金受取りコース(一般コース)」 ・収益分配金は、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。 ・収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。 ・受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。 「分配金再投資コース(累積投資コース)」 ・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。
償還金に対する請求権	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。 ・償還金は、原則として償還日(休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までに支払いを開始します。 ・償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。 ・受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。
換金(解約)請求権	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。 ・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。 (「第2 手続等 2 換金(解約)手続等」をご参照ください。)

第4【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、前特定期間（平成20年7月18日から平成21年1月19日まで）については、改正前の「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、当特定期間（平成21年1月20日から平成21年7月17日まで）については、改正後の「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。ただし、当特定期間については「投資信託及び投資法人に関する法律施行規則等の一部を改正する内閣府令」（平成21年内閣府令第35号）の附則第16条第2項本文を適用しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- 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、前特定期間（平成20年7月18日から平成21年1月19日まで）および当特定期間（平成21年1月20日から平成21年7月17日まで）の財務諸表について、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21年1月19日現在]	当期 [平成21年7月17日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,435,159	2,387,886
親投資信託受益証券	1,603,389,627	1,751,726,939
未収入金	4,710,600	4,710,200
未収利息	12	7
流動資産合計	1,611,535,398	1,758,825,032
資産合計	1,611,535,398	1,758,825,032
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	6,832,717	4,711,999
未払解約金	153,083	1,159,114
未払受託者報酬	77,552	75,622
未払委託者報酬	1,085,697	1,058,700
その他未払費用	31,500	31,500
流動負債合計	8,180,549	7,036,935
負債合計	8,180,549	7,036,935
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,070,776,514	1 2,148,146,818
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 467,421,665	2 396,358,721
（分配準備積立金）	199,352	3,273,401
元本等合計	1,603,354,849	1,751,788,097
純資産合計	1,603,354,849	1,751,788,097
負債純資産合計	1,611,535,398	1,758,825,032

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自平成20年7月18日 至平成21年1月19日	当期 自平成21年1月20日 至平成21年7月17日
営業収益		
受取利息	8,823	973
有価証券売買等損益	344,471,178	122,580,512
営業収益合計	344,462,355	122,581,485
営業費用		
受託者報酬	468,344	440,552
委託者報酬	6,556,815	6,167,668
その他費用	189,049	190,912
営業費用合計	7,214,208	6,799,132
営業利益	351,676,563	115,782,353
経常利益	351,676,563	115,782,353
当期純利益	351,676,563	115,782,353
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	9,316,084	2,913,977
期首剰余金又は期首欠損金()	63,897,028	467,421,665
剰余金増加額又は欠損金減少額	34,207,610	36,121,771
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	34,207,610	36,121,771
剰余金減少額又は欠損金増加額	55,294,915	49,935,728
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	55,294,915	49,935,728
分配金	40,076,853	27,991,475
期末剰余金又は期末欠損金()	467,421,665	396,358,721

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	前期 (自平成20年7月18日 至平成21年1月19日)	当期 (自平成21年1月20日 至平成21年7月17日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 親投資信託受益証券以外の有価証券 個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における特定期間末日の最終相場で評価しております。</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>(1) 親投資信託受益証券 同 左</p> <p>(2) 親投資信託受益証券以外の有価証券 同 左</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券 同 左</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同 左</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 同 左</p>
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>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20年7月18日から平成21年1月19日までとなっております。</p>	<p>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、前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21年1月20日から平成21年7月17日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	前期 [平成21年1月19日現在]	当期 [平成21年7月17日現在]
1 期首元本額	1,991,413,180円	2,070,776,514円
期中追加設定元本額	448,280,156円	257,226,592円
期中一部解約元本額	368,916,822円	179,856,288円
2 元本の欠損 貸借対照表上の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。	467,421,665円	396,358,721円
3 特定期間末日における受益権の総数	2,070,776,514口	2,148,146,818口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7743円 (7,743円)	0.8155円 (8,155円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期(自平成20年7月18日 至 平成21年1月19日)

1 分配金の計算過程

(自平成20年7月18日 至 平成20年8月18日)		
費用控除後の配当等収益額	A	7,385,358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	18,244,719円
分配準備積立金額	D	4,818,161円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	30,448,238円
当ファンドの期末残存口数	F	1,998,730,409口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	152円
1万口当たり分配金額	H	33円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,595,810円

		(自 平成20年8月19日 至 平成20年9月17日)
費用控除後の配当等収益額	A	5,745,396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	18,995,478円
分配準備積立金額	D	5,483,506円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	30,224,380円
当ファンドの期末残存口数	F	2,043,078,583口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	147円
1万口当たり分配金額	H	33円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,742,159円
外国税控除額	J	14円
控除後の分配金金額	K=I-J	6,742,145円

		(自 平成20年9月18日 至 平成20年10月17日)
費用控除後の配当等収益額	A	5,331,146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	18,784,722円
分配準備積立金額	D	4,162,063円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	28,277,931円
当ファンドの期末残存口数	F	1,986,603,865口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	142円
1万口当たり分配金額	H	33円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,555,792円
外国税控除額	J	23円
控除後の分配金金額	K=I-J	6,555,769円

		(自 平成20年10月18日 至 平成20年11月17日)
費用控除後の配当等収益額	A	4,797,030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	19,076,945円
分配準備積立金額	D	2,857,074円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	26,731,049円
当ファンドの期末残存口数	F	1,998,599,574口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	133円
1万口当たり分配金額	H	33円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,595,378円
外国税控除額	J	876円
控除後の分配金金額	K=I-J	6,594,502円

		(自 平成20年11月18日 至 平成20年12月17日)
費用控除後の配当等収益額	A	5,637,688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	19,640,890円
分配準備積立金額	D	1,047,321円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	26,325,899円
当ファンドの期末残存口数	F	2,047,620,005口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	128円
1万口当たり分配金額	H	33円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,757,146円
外国税控除額	J	1,236円
控除後の分配金金額	K=I-J	6,755,910円

		(自 平成20年12月18日 至 平成21年1月19日)
費用控除後の配当等収益額	A	5,036,158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	19,717,853円
分配準備積立金額	D	132,212円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	24,886,223円
当ファンドの期末残存口数	F	2,070,776,514口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	120円
1万口当たり分配金額	H	33円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,833,562円
外国税控除額	J	845円
控除後の分配金金額	K=I-J	6,832,717円

当期(自平成21年1月20日 至 平成21年7月17日)

1 分配金の計算過程

		(自平成21年1月20日 至 平成21年2月17日)
費用控除後の配当等収益額	A	4,119,540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	18,144,735円
分配準備積立金額	D	197,781円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	22,462,056円
当ファンドの期末残存口数	F	2,099,409,104口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	106円
1万口当たり分配金額	H	22円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	4,618,700円
外国税控除額	J	1,477円
控除後の分配金金額	K=I-J	4,617,223円

		(自平成21年2月18日 至 平成21年3月17日)
費用控除後の配当等収益額	A	5,357,599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	17,813,847円
分配準備積立金額	D	118,303円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	23,289,749円
当ファンドの期末残存口数	F	2,106,954,696口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	110円
1万口当たり分配金額	H	22円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	4,635,300円
外国税控除額	J	9,870円
控除後の分配金金額	K=I-J	4,625,430円

		(自平成21年3月18日 至 平成21年4月17日)
費用控除後の配当等収益額	A	5,978,234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	18,033,260円
分配準備積立金額	D	841,326円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	24,852,820円
当ファンドの期末残存口数	F	2,126,021,974口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	116円
1万口当たり分配金額	H	22円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	4,677,248円
外国税控除額	J	5,509円
控除後の分配金金額	K=I-J	4,671,739円

		(自平成21年4月18日 至 平成21年5月18日)
費用控除後の配当等収益額	A	4,814,944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	18,197,959円
分配準備積立金額	D	2,122,114円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	25,135,017円
当ファンドの期末残存口数	F	2,136,787,377口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	117円
1万口当たり分配金額	H	22円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	4,700,932円
外国税控除額	J	10,387円
控除後の分配金金額	K=I-J	4,690,545円

		(自平成21年5月19日 至 平成21年6月17日)
費用控除後の配当等収益額	A	5,812,611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	18,205,809円
分配準備積立金額	D	2,183,849円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	26,202,269円
当ファンドの期末残存口数	F	2,128,068,428口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	123円
1万口当たり分配金額	H	22円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	4,681,750円
外国税控除額	J	7,211円

控除後の分配金金額	K=I-J	4,674,539円
(自平成21年6月18日至平成21年7月17日)		
費用控除後の配当等収益額	A	4,701,824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	18,490,888円
分配準備積立金額	D	3,283,576円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	26,476,288円
当ファンドの期末残存口数	F	2,148,146,818口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	123円
1万口当たり分配金金額	H	22円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	4,725,922円
外国税控除額	J	13,923円
控除後の分配金金額	K=I-J	4,711,999円

(有価証券関係に関する注記)
売買目的有価証券

種 類	前 期 [平成21年1月19日現在]		当 期 [平成21年7月17日現在]	
	貸借対照表計上額(円)	最終計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	貸借対照表計上額(円)	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	1,603,389,627	11,857,443	1,751,726,939	5,165,644
合計	1,603,389,627	11,857,443	1,751,726,939	5,165,644

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

- 取引の状況に関する事項
該当事項はありません。
- 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(口)	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	956,600,557	1,751,726,939	
	親投資信託受益証券 小計	956,600,557	1,751,726,939	
合計		956,600,557	1,751,726,939	

- 第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

- 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

<参考>

当ファンドは「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ており、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」は、同親投資信託の受益証券です。

なお、同親投資信託の状況は次の通りです。

「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21年1月19日現在]	[平成21年7月17日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	664,278,602	374,938,842
コール・ローン	86,497,925	185,403,611
国債証券	220,902,840,921	232,309,287,254
派生商品評価勘定	1,800	420
未収入金	3,665,683,640	51,069,022
未収利息	3,330,460,423	3,182,605,912
前払費用	153,342,596	250,971,072
流動資産合計	228,803,105,907	236,354,276,133
資産合計	228,803,105,907	236,354,276,133
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,964,180	27,600
未払金	3,732,515,627	132,697,712
未払解約金	84,246,250	100,938,382
流動負債合計	3,818,726,057	233,663,694
負債合計	3,818,726,057	233,663,694
純資産の部		
元本等		
元本	1 132,050,450,357	128,940,476,407
剰余金		
剰余金又は欠損金()	92,933,929,493	107,180,136,032
元本等合計	224,984,379,850	236,120,612,439
純資産合計	224,984,379,850	236,120,612,439
負債純資産合計	228,803,105,907	236,354,276,133

(注) 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)

区分	(自平成20年7月18日 至平成21年1月19日)	(自平成21年1月20日 至平成21年7月17日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>同左</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算期間末日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>	<p>為替予約取引 同左</p>

区分	(自平成20年7月18日 至平成21年1月19日)	(自平成21年1月20日 至平成21年7月17日)
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6 0条および第61条にしたがって処理して おります。	外貨建資産等の会計処理 同左

(貸借対照表に関する注記)

	[平成21年1月19日現在]	[平成21年7月17日現在]
1 期首		
期首元本額	平成20年7月18日 145,624,145,298円	平成21年1月20日 132,050,450,357円
期首からの追加設定元本額	4,013,098,583円	7,991,212,701円
期首からの一部解約元本額	17,586,793,524円	11,101,186,651円
元本の内訳*		
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	99,688,642円	102,512,874円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	136,932,509円	146,200,057円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	80,197,321円	88,588,595円
三菱UFJ 外国債券オープン	4,122,275,216円	4,095,824,521円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	412,090,853円	445,852,756円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	1,092,717,241円	1,209,927,542円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	595,868,042円	699,972,730円
三菱UFJ 財産分散ファンド(毎月決算型)	3,369,056,401円	3,352,811,816円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	2,067,818,773円	2,004,247,179円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	198,915,697円	205,840,149円
FPバランスファンド(安定型)		51,025,789円
FPバランスファンド(安定成長型)		69,373,742円
三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金)	1,401,261,289円	1,458,538,995円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型)	941,066,808円	956,600,557円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)	696,367,833円	904,767,950円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	112,688,153,191円	109,207,422,747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)	4,740,012円	4,534,081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)	16,107,167円	15,738,607円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2(適格機関投資家限定)	505,030,209円	492,469,312円
ワールドバランス2005	127,799,837円	36,326,896円
ワールドバランス2006	205,225,990円	163,919,086円
MUAM 世界国債インデックスファンド2007-12(適格機関投資家限定)	3,289,137,326円	3,227,980,426円
(合計)	132,050,450,357円	128,940,476,407円
2 計算期間末日における受益権の総数	132,050,450,357口	128,940,476,407口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7038円 (17,038円)	1.8312円 (18,312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

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[平成21年1月19日現在]		[平成21年7月17日現在]	
	貸借対照表計上額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	貸借対照表計上額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
国債証券	220,902,840,921	11,295,109,263	232,309,287,254	688,990,437
合計	220,902,840,921	11,295,109,263	232,309,287,254	688,990,437

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、当該親投資信託の期首日から開示対象ファンドの特定期間末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

1 取引の状況に関する事項

区分	(自平成20年7月18日 至平成21年1月19日)	(自平成21年1月20日 至平成21年7月17日)
1 取引の内容、取引の利用目的及び取引に対する取組方針	当ファンドは、外貨の決済のために、その受渡までの期間がごく短い為替予約取引を利用しております。	同 左
2 取引に係るリスクの内容	外貨の決済のために行う為替予約取引は、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
3 取引に係るリスクの管理体制	運用部門において、資産構成比率に関する事項や、その他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、運用部門から独立した管理部門によってリスク運営状況等をモニタリングする体制をとっており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同 左
4 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同 左

2 取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種類	[平成21年1月19日現在]			
		契約額等(円)		時価	評価損益
			うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカドル	34,956,900		35,493,900	537,000
	イギリスポンド	9,122,400		9,459,800	337,400
	スイスフラン	2,399,400		2,442,900	43,500
	ノルウェークローネ	2,649,800		2,648,000	1,800
	ユーロ	58,364,320		59,410,600	1,046,280
	合計	107,492,820		109,455,200	1,962,380

区分	種類	[平成21年7月17日現在]			
		契約額等(円)		時価	評価損益
			うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカドル	20,631,600		20,631,600	
	イギリスポンド	4,608,900		4,608,600	300
	シンガポールドル	2,583,320		2,583,200	120
	ユーロ	31,764,960		31,768,800	3,840
	買建				
	ユーロ	7,965,960		7,942,200	23,760
	合計	67,554,740		67,534,400	27,180

(注) 時価の算定方法

- 1 計算期間末日に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。

計算期間末日において為替予約の受渡日（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。

計算期間末日において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) 計算期間末日に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) 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 2 計算期間末日に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、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

(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。

[次へ](#)

(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	0.875 T-NOTE 101231	9,000,000.00	9,017,578.17	
	0.875 T-NOTE 110131	9,000,000.00	9,015,468.75	
	0.875 T-NOTE 110228	2,500,000.00	2,502,148.45	
	0.875 T-NOTE 110331	1,800,000.00	1,800,984.38	
	0.875 T-NOTE 110430	2,500,000.00	2,498,632.82	
	1.125 T-NOTE 111215	7,900,000.00	7,878,398.47	
	1.125 T-NOTE 120115	8,200,000.00	8,167,328.16	
	1.25 T-NOTE 101130	4,700,000.00	4,735,617.20	
	1.375 T-NOTE 120215	8,000,000.00	8,011,250.00	
	1.375 T-NOTE 120315	5,300,000.00	5,303,312.50	
	1.375 T-NOTE 120415	6,100,000.00	6,092,375.00	
	1.375 T-NOTE 120515	8,600,000.00	8,577,156.24	
	1.5 T-NOTE 101031	6,000,000.00	6,067,031.28	
	1.5 T-NOTE 131231	7,500,000.00	7,267,382.85	
	1.75 T-NOTE 111115	7,000,000.00	7,087,500.00	
	1.75 T-NOTE 140131	7,300,000.00	7,136,320.34	
	1.75 T-NOTE 140331	8,000,000.00	7,781,250.00	
	1.875 T-NOTE 120615	7,000,000.00	7,072,734.41	
	1.875 T-NOTE 140228	8,000,000.00	7,840,000.00	
	1.875 T-NOTE 140430	6,500,000.00	6,346,640.62	
	2 T-NOTE 100930	6,300,000.00	6,408,281.25	
	2 T-NOTE 131130	7,000,000.00	6,940,390.66	
	2.25 T-NOTE 140531	4,500,000.00	4,462,382.83	
	2.375 T-NOTE 100831	4,000,000.00	4,081,250.00	
	2.375 T-NOTE 160331	5,300,000.00	5,073,093.75	
	2.5 T-NOTE 130331	4,000,000.00	4,086,250.00	
	2.625 T-NOTE 140630	9,400,000.00	9,477,109.42	
	2.625 T-NOTE 160229	4,500,000.00	4,384,687.50	
	2.625 T-NOTE 160430	4,200,000.00	4,078,593.75	
	2.75 T-NOTE 100731	5,000,000.00	5,115,234.40	
	2.75 T-NOTE 130228	3,500,000.00	3,610,742.20	
	2.75 T-NOTE 131031	6,000,000.00	6,143,437.50	
	2.75 T-NOTE 190215	14,300,000.00	13,368,265.61	
	2.875 T-NOTE 100630	4,200,000.00	4,296,468.75	
	2.875 T-NOTE 130131	3,500,000.00	3,624,960.95	
	3.125 T-NOTE 130430	4,000,000.00	4,170,625.00	
	3.125 T-NOTE 130831	4,500,000.00	4,685,625.00	
	3.125 T-NOTE 130930	7,100,000.00	7,383,445.34	
	3.125 T-NOTE 190515	9,900,000.00	9,544,218.75	
	3.25 T-NOTE 160531	4,000,000.00	4,033,125.00	
	3.375 T-NOTE 121130	3,300,000.00	3,481,757.82	
	3.375 T-NOTE 130630	5,000,000.00	5,259,375.00	
	3.375 T-NOTE 130731	5,000,000.00	5,259,375.00	
	3.5 T-BOND 390215	6,300,000.00	5,324,484.36	
	3.5 T-NOTE 130531	4,900,000.00	5,179,835.96	
	3.5 T-NOTE 180215	8,500,000.00	8,530,546.87	
	3.625 T-NOTE 121231	3,300,000.00	3,503,929.70	
	3.625 T-NOTE 130515	4,600,000.00	4,883,546.89	
	3.75 T-NOTE 181115	13,400,000.00	13,615,656.25	
	3.875 T-NOTE 100715	4,200,000.00	4,342,734.39	
	3.875 T-NOTE 100915	4,100,000.00	4,257,914.08	
	3.875 T-NOTE 121031	3,300,000.00	3,534,093.75	
	3.875 T-NOTE 130215	4,300,000.00	4,607,046.87	
	3.875 T-NOTE 180515	6,700,000.00	6,895,765.62	
	4 T-NOTE 121115	4,600,000.00	4,942,843.75	
	4 T-NOTE 140215	8,400,000.00	9,033,937.50	
	4 T-NOTE 150215	8,700,000.00	9,292,687.50	
	4 T-NOTE 180815	7,500,000.00	7,775,390.62	
	4.125 T-NOTE 100815	6,500,000.00	6,754,667.98	
	4.125 T-NOTE 120831	3,000,000.00	3,233,203.14	

通貨 種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
	4.125 T-NOTE 150515	7,900,000.00	8,466,578.12	
	4.25 T-BOND 390515	6,000,000.00	5,805,937.50	
	4.25 T-NOTE 101015	4,200,000.00	4,390,312.50	
	4.25 T-NOTE 110115	4,400,000.00	4,627,906.27	
	4.25 T-NOTE 120930	3,200,000.00	3,460,000.00	
	4.25 T-NOTE 130815	7,500,000.00	8,137,500.00	
	4.25 T-NOTE 131115	7,500,000.00	8,135,156.25	
	4.25 T-NOTE 140815	6,000,000.00	6,507,187.50	
	4.25 T-NOTE 141115	6,100,000.00	6,600,390.62	
	4.25 T-NOTE 150815	6,800,000.00	7,318,500.00	
	4.25 T-NOTE 171115	5,400,000.00	5,722,312.50	
	4.375 T-BOND 380215	3,900,000.00	3,854,906.25	
	4.375 T-NOTE 101215	4,200,000.00	4,418,203.14	
	4.375 T-NOTE 120815	4,400,000.00	4,770,562.50	
	4.5 T-BOND 360215	6,100,000.00	6,154,328.12	
	4.5 T-BOND 380515	5,300,000.00	5,362,109.37	
	4.5 T-NOTE 101115	6,000,000.00	6,305,625.00	
	4.5 T-NOTE 110228	5,000,000.00	5,300,781.25	
	4.5 T-NOTE 110930	6,000,000.00	6,442,968.78	
	4.5 T-NOTE 111130	6,000,000.00	6,461,718.78	
	4.5 T-NOTE 120331	3,700,000.00	4,011,898.45	
	4.5 T-NOTE 120430	3,700,000.00	4,013,054.70	
	4.5 T-NOTE 151115	5,500,000.00	6,001,015.62	
	4.5 T-NOTE 160215	5,600,000.00	6,102,250.00	
	4.5 T-NOTE 170515	5,100,000.00	5,509,593.75	
	4.625 T-NOTE 110831	5,500,000.00	5,908,632.84	
	4.625 T-NOTE 111031	4,300,000.00	4,633,250.00	
	4.625 T-NOTE 111231	4,000,000.00	4,329,062.52	
	4.625 T-NOTE 120229	2,500,000.00	2,716,015.62	
	4.625 T-NOTE 120731	2,000,000.00	2,184,062.50	
	4.625 T-NOTE 161115	5,300,000.00	5,795,218.75	
	4.625 T-NOTE 170215	5,400,000.00	5,885,156.25	
	4.75 T-BOND 370215	3,500,000.00	3,675,546.87	
	4.75 T-NOTE 110331	5,300,000.00	5,650,296.87	
	4.75 T-NOTE 120131	3,000,000.00	3,262,031.25	
	4.75 T-NOTE 120531	3,200,000.00	3,498,000.00	
	4.75 T-NOTE 140515	7,300,000.00	8,090,453.12	
	4.75 T-NOTE 170815	4,800,000.00	5,266,875.02	
	4.875 T-NOTE 110430	4,500,000.00	4,818,867.21	
	4.875 T-NOTE 110531	5,000,000.00	5,365,234.40	
	4.875 T-NOTE 110731	10,500,000.00	11,312,929.74	
	4.875 T-NOTE 120215	6,500,000.00	7,097,187.50	
	4.875 T-NOTE 120630	2,900,000.00	3,183,203.12	
	4.875 T-NOTE 160815	4,800,000.00	5,328,750.00	
	5 T-BOND 370515	3,600,000.00	3,924,562.50	
	5 T-NOTE 110215	15,500,000.00	16,534,140.62	
	5 T-NOTE 110815	8,500,000.00	9,195,937.50	
	5.125 T-NOTE 110630	5,300,000.00	5,721,101.58	
	5.125 T-NOTE 160515	5,500,000.00	6,196,093.75	
	5.25 T-BOND 281115	2,400,000.00	2,656,125.00	
	5.25 T-BOND 290215	2,400,000.00	2,654,625.00	
	5.375 T-BOND 310215	3,700,000.00	4,163,656.25	
	5.5 T-BOND 280815	2,500,000.00	2,842,187.50	
	5.75 T-NOTE 100815	19,600,000.00	20,702,500.00	
	6 T-BOND 260215	2,800,000.00	3,337,250.00	
	6.125 T-BOND 271115	4,500,000.00	5,467,500.00	
	6.125 T-BOND 290815	2,300,000.00	2,817,140.62	
	6.25 T-BOND 230815	4,800,000.00	5,789,250.00	
	6.25 T-BOND 300515	3,800,000.00	4,736,343.75	
	6.375 T-BOND 270815	1,700,000.00	2,117,828.12	
	6.5 T-BOND 261115	2,200,000.00	2,763,406.25	
	6.625 T-BOND 270215	1,800,000.00	2,290,781.25	
	6.75 T-BOND 260815	1,700,000.00	2,185,296.87	
	6.875 T-BOND 250815	2,400,000.00	3,111,375.00	
	7.125 T-BOND 230215	3,100,000.00	4,012,562.50	
	7.25 T-BOND 160515	4,200,000.00	5,268,375.00	
	7.25 T-BOND 220815	2,200,000.00	2,870,312.50	
	7.5 T-BOND 161115	3,100,000.00	3,951,046.87	
	7.5 T-BOND 241115	2,000,000.00	2,720,625.00	
	7.625 T-BOND 221115	1,400,000.00	1,886,281.25	

通貨		銘柄	券面総額	評価額	備考
種類					
		7.625 T-BOND 250215	2,000,000.00	2,757,187.49	
		7.875 T-BOND 210215	2,200,000.00	2,974,812.50	
		8 T-BOND 211115	6,600,000.00	9,061,593.75	
		8.125 T-BOND 190815	3,200,000.00	4,367,500.00	
		8.125 T-BOND 210515	2,200,000.00	3,031,875.00	
		8.125 T-BOND 210815	1,900,000.00	2,624,671.87	
		8.5 T-BOND 200215	1,800,000.00	2,520,281.25	
		8.75 T-BOND 170515	2,600,000.00	3,549,000.00	
		8.75 T-BOND 200815	2,800,000.00	3,997,437.50	
		8.875 T-BOND 170815	1,800,000.00	2,482,453.13	
		8.875 T-BOND 190215	2,400,000.00	3,410,625.00	
		国債証券 小計	730,000,000.00	777,451,403.07 (72,917,167,093)	
アメリカドル 小計			730,000,000.00	777,451,403.07 (72,917,167,093)	
カナダドル					
国債証券		1 CAN GOVT 110901	400,000.00	396,668.00	
		1.25 CAN GOVT 110601	1,300,000.00	1,301,170.00	
		2 CAN GOVT 120901	600,000.00	599,538.00	
		2 CAN GOVT 141201	1,200,000.00	1,159,644.00	
		2.75 CAN GOVT 101201	2,400,000.00	2,464,128.00	
		3 CAN GOVT 140601	4,000,000.00	4,088,400.00	
		3.5 CAN GOVT 130601	3,500,000.00	3,655,785.00	
		3.75 CAN GOVT 110901	2,450,000.00	2,569,903.00	
		3.75 CAN GOVT 120601	2,100,000.00	2,210,796.00	
		3.75 CAN GOVT 190601	3,500,000.00	3,596,250.00	
		4 CAN GOVT 100901	2,400,000.00	2,492,016.00	
		4 CAN GOVT 160601	2,700,000.00	2,874,420.00	
		4 CAN GOVT 170601	2,700,000.00	2,860,488.00	
		4 CAN GOVT 410601	1,400,000.00	1,403,122.00	
		4.25 CAN GOVT 180601	2,800,000.00	3,004,260.00	
		4.5 CAN GOVT 150601	2,900,000.00	3,169,381.00	
		5 CAN GOVT 140601	2,800,000.00	3,115,476.00	
		5 CAN GOVT 370601	3,700,000.00	4,347,500.00	
		5.25 CAN GOVT 120601	2,750,000.00	3,009,847.50	
		5.25 CAN GOVT 130601	2,400,000.00	2,660,880.00	
		5.75 CAN GOVT 290601	3,300,000.00	4,051,443.00	
		5.75 CAN GOVT 330601	3,400,000.00	4,268,870.00	
		6 CAN GOVT 110601	4,600,000.00	5,006,962.00	
		8 CAN GOVT 230601	1,100,000.00	1,584,352.00	
		8 CAN GOVT 270601	1,700,000.00	2,542,894.00	
		9 CAN GOVT 250601	1,000,000.00	1,578,840.00	
		国債証券 小計	63,100,000.00	70,013,033.50 (5,870,592,858)	
カナダドル 小計			63,100,000.00	70,013,033.50 (5,870,592,858)	
オーストラリアドル					
国債証券		4.5 AUST GOVT 200415	500,000.00	456,368.00	
		5.25 AUST GOVT 100815	2,000,000.00	2,040,012.00	
		5.25 AUST GOVT 190315	2,100,000.00	2,064,728.40	
		5.75 AUST GOVT 110615	2,500,000.00	2,581,887.50	
		5.75 AUST GOVT 120415	2,300,000.00	2,374,888.00	
		5.75 AUST GOVT 210515	1,700,000.00	1,723,891.80	
		6 AUST GOVT 170215	2,100,000.00	2,180,070.90	
		6.25 AUST GOVT 140615	800,000.00	837,568.00	
		6.25 AUST GOVT 150415	2,500,000.00	2,618,632.50	
		6.5 AUST GOVT 130515	1,980,000.00	2,092,814.46	
		国債証券 小計	18,480,000.00	18,970,861.56 (1,426,988,206)	
オーストラリアドル 小計			18,480,000.00	18,970,861.56 (1,426,988,206)	
イギリスポンド					
国債証券		2.25 GILT 140307	2,900,000.00	2,805,750.00	
		3.25 GILT 111207	4,000,000.00	4,140,000.00	
		4 GILT 160907	4,200,000.00	4,372,200.00	
		4 GILT 220307	700,000.00	696,500.00	
		4.25 GILT 110307	6,000,000.00	6,294,000.00	
		4.25 GILT 271207	3,700,000.00	3,647,349.00	
		4.25 GILT 320607	4,300,000.00	4,188,974.00	
		4.25 GILT 360307	5,300,000.00	5,139,463.00	

通貨		券面総額	評価額	備考
種類	銘柄			
	4.25 GILT 390907	1,000,000.00	962,000.00	
	4.25 GILT 461207	4,700,000.00	4,527,604.00	
	4.25 GILT 491207	3,400,000.00	3,269,100.00	
	4.25 GILT 551207	5,400,000.00	5,219,100.00	
	4.5 GILT 130307	6,100,000.00	6,472,100.00	
	4.5 GILT 190307	5,700,000.00	6,032,025.00	
	4.5 GILT 340907	1,600,000.00	1,603,344.00	
	4.5 GILT 421207	5,000,000.00	5,015,000.00	
	4.75 GILT 150907	3,900,000.00	4,264,650.00	
	4.75 GILT 200307	2,500,000.00	2,705,000.00	
	4.75 GILT 301207	4,000,000.00	4,160,760.00	
	4.75 GILT 381207	5,600,000.00	5,913,600.00	
	5 GILT 120307	7,300,000.00	7,829,250.00	
	5 GILT 140907	2,200,000.00	2,421,100.00	
	5 GILT 180307	3,600,000.00	4,008,600.00	
	5 GILT 250307	5,000,000.00	5,415,000.00	
	5.25 GILT 120607	3,750,000.00	4,060,162.50	
	6 GILT 281207	3,300,000.00	4,017,948.00	
	6.25 GILT 101125	1,700,000.00	1,824,100.00	
	8 GILT 130927	2,300,000.00	2,773,340.00	
	8 GILT 151207	1,500,000.00	1,916,850.00	
	8 GILT 210607	1,900,000.00	2,640,050.00	
	8.75 GILT 170825	2,000,000.00	2,742,960.00	
	9 GILT 110712	1,900,000.00	2,182,530.00	
	国債証券 小計	116,450,000.00	123,260,409.50 (18,937,729,315)	
	イギリスポンド 小計	116,450,000.00	123,260,409.50 (18,937,729,315)	
	スイスフラン			
国債証券	2.5 SWISS GOVT 160312	1,750,000.00	1,814,750.00	
	2.75 SWISS GOVT 120610	1,900,000.00	2,007,730.00	
	3 SWISS GOVT 180108	1,600,000.00	1,707,840.00	
	3 SWISS GOVT 190512	1,260,000.00	1,345,050.00	
	3.5 SWISS GOVT 100807	2,300,000.00	2,373,830.00	
	4 SWISS GOVT 110610	1,700,000.00	1,815,260.00	
	4 SWISS GOVT 130211	2,000,000.00	2,206,000.00	
	4 SWISS GOVT 230211	1,200,000.00	1,381,080.00	
	4 SWISS GOVT 280408	1,400,000.00	1,614,200.00	
	4.25 SWISS GOVT 140106	1,400,000.00	1,575,000.00	
	4.25 SWISS GOVT 170605	1,400,000.00	1,617,700.00	
	国債証券 小計	17,910,000.00	19,458,440.00 (1,696,970,552)	
	スイスフラン 小計	17,910,000.00	19,458,440.00 (1,696,970,552)	
	シンガポールドル			
国債証券	1.625SINGAPORGOVT 130401	600,000.00	617,962.20	
	2.25 SINGAPORGOVT 130701	800,000.00	840,423.20	
	2.5 SINGAPORGOVT 121001	300,000.00	317,390.70	
	2.5 SINGAPORGOVT 190601	300,000.00	299,239.50	
	2.625SINGAPORGOVT 120401	700,000.00	738,303.30	
	2.875SINGAPORGOVT 150701	300,000.00	320,959.50	
	3.125SINGAPORGOVT 110201	700,000.00	728,980.70	
	3.125SINGAPORGOVT 220901	800,000.00	811,340.80	
	3.25 SINGAPORGOVT 200901	900,000.00	941,405.40	
	3.5 SINGAPORGOVT 120701	1,600,000.00	1,735,427.20	
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	1,000,000.00	1,026,113.00	
	3.625SINGAPORGOVT 110701	700,000.00	742,529.90	
	3.625SINGAPORGOVT 140701	1,600,000.00	1,782,513.60	
	3.75 SINGAPORGOVT 160901	1,300,000.00	1,443,653.90	
	4 SINGAPORGOVT 180901	1,100,000.00	1,247,583.70	
	4.625SINGAPORGOVT100701	1,600,000.00	1,665,676.80	
	国債証券 小計	14,300,000.00	15,259,503.40 (985,611,324)	
	シンガポールドル 小計	14,300,000.00	15,259,503.40 (985,611,324)	
	マレーシアリンギット			

通貨		券面総額	評価額	備考
種類	銘柄			
国債証券	2.509MALAYSIAGOV 120827	1,000,000.00	986,993.00	
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3,000,000.00	2,559,762.00	
	3.718MALAYSIAGOV 120615	15,000,000.00	15,356,475.00	
	3.756MALAYSIAGOV 110428	7,500,000.00	7,676,032.50	
	3.814MALAYSIAGOV 170215	1,600,000.00	1,574,024.00	
	4.262MALAYSIAGOV 160915	10,000,000.00	10,144,040.00	
	5.094MALAYSIAGOV 140430	5,500,000.00	5,841,627.00	
	5.734MALAYSIAGOV 190730	2,000,000.00	2,230,424.00	
	国債証券 小計	45,600,000.00	46,369,377.50 (1,219,978,322)	
マレーシアリングgit 小計		45,600,000.00	46,369,377.50 (1,219,978,322)	
スウェーデンクローネ				
国債証券	3 SWD GOVT 160712	11,500,000.00	11,449,975.00	
	3.5 SWD GOVT 390330	10,000,000.00	9,042,300.00	
	3.75 SWD GOVT 170812	12,000,000.00	12,453,360.00	
	4.25 SWD GOVT 190312	13,900,000.00	14,890,653.00	
	4.5 SWD GOVT 150812	10,500,000.00	11,436,075.00	
	5 SWD GOVT 201201	15,400,000.00	17,424,484.00	
	5.25 SWD GOVT 110315	13,300,000.00	14,256,403.00	
	5.5 SWD GOVT 121008	15,500,000.00	17,217,400.00	
	6.75 SWD GOVT 140505	18,500,000.00	21,983,735.00	
		国債証券 小計	120,600,000.00	130,154,385.00 (1,560,551,076)
スウェーデンクローネ 小計		120,600,000.00	130,154,385.00 (1,560,551,076)	
ノルウェークローネ				
国債証券	4.25 NORWE GOVT 170519	7,700,000.00	7,938,700.00	
	5 NORWE GOVT 150515	9,500,000.00	10,249,550.00	
	6 NORWE GOVT 110516	11,100,000.00	11,913,630.00	
	6.5 NORWE GOVT 130515	13,100,000.00	14,780,730.00	
		国債証券 小計	41,400,000.00	44,882,610.00 (659,774,367)
ノルウェークローネ 小計		41,400,000.00	44,882,610.00 (659,774,367)	
デンマーククローネ				
国債証券	4 DMK GOVT 101115	11,900,000.00	12,262,950.00	
	4 DMK GOVT 151115	14,700,000.00	15,251,250.00	
	4 DMK GOVT 171115	13,600,000.00	13,976,720.00	
	4.5 DMK GOVT 391115	22,600,000.00	23,956,000.00	
	5 DMK GOVT 131115	18,500,000.00	20,165,000.00	
	6 DMK GOVT 111115	17,200,000.00	18,832,280.00	
	7 DMK GOVT 241110	6,300,000.00	8,319,150.00	
		国債証券 小計	104,800,000.00	112,763,350.00 (2,004,932,363)
デンマーククローネ 小計		104,800,000.00	112,763,350.00 (2,004,932,363)	
ポーランドズロチ				
国債証券	4.25 POLAND 110524	9,000,000.00	8,902,800.00	
	4.75 POLAND 120425	8,400,000.00	8,316,840.00	
	5 POLAND 131024	7,000,000.00	6,902,700.00	
	5.25 POLAND 130425	4,900,000.00	4,883,340.00	
	5.25 POLAND 171025	7,400,000.00	7,096,600.00	
	5.5 POLAND 191025	1,600,000.00	1,520,800.00	
	5.75 POLAND 140425	3,900,000.00	3,946,800.00	
	5.75 POLAND 220923	7,700,000.00	7,357,350.00	
	6 POLAND 101124	9,900,000.00	10,048,500.00	
	6.25 POLAND 151024	6,300,000.00	6,490,260.00	
	国債証券 小計	66,100,000.00	65,465,990.00 (2,004,568,613)	
ポーランドズロチ 小計		66,100,000.00	65,465,990.00 (2,004,568,613)	
ユーロ				
国債証券	1.25 SCHATS 110311	2,300,000.00	2,307,337.00	
	1.5 SCHATS 110610	500,000.00	502,585.00	
	2 BEL GOVT 120328	700,000.00	701,960.00	
	2.25 OBL 140411	4,800,000.00	4,767,744.00	
	2.25 SCHATS 101210	2,000,000.00	2,036,520.00	
	2.5 BTAN 140112	4,700,000.00	4,686,840.00	

通貨 種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
	2.5 NETH GOVT 120115	2,400,000.00	2,446,800.00	
	2.5 OBL 101008	5,500,000.00	5,612,860.00	
	2.75 FINNISH GOVT 100915	200,000.00	204,280.00	
	2.75 SPAIN GOVT 120430	2,500,000.00	2,545,750.00	
	3 BTAN 110112	4,200,000.00	4,321,380.00	
	3 ITALY GOVT 120301	2,700,000.00	2,760,210.00	
	3 O.A.T 151025	6,400,000.00	6,382,080.00	
	3.125 FINNISHGOVT 140915	1,600,000.00	1,628,320.00	
	3.15 SPAIN GOVT 160131	3,800,000.00	3,750,980.00	
	3.2 PORTUGUESE 110415	1,800,000.00	1,848,420.00	
	3.25 BEL GOVT 160928	3,200,000.00	3,156,160.00	
	3.25 BUND 150704	5,500,000.00	5,654,880.00	
	3.25 NETH GOVT 150715	3,100,000.00	3,137,200.00	
	3.25 O.A.T 160425	5,300,000.00	5,334,450.00	
	3.25 SPAIN GOVT 100730	4,200,000.00	4,307,100.00	
	3.35 PORTUGUESE 151015	1,800,000.00	1,774,800.00	
	3.4 AUSTRIA GOVT 141020	1,200,000.00	1,213,080.00	
	3.5 AUSTRIA GOVT 150715	2,700,000.00	2,712,960.00	
	3.5 AUSTRIA GOVT 210915	2,500,000.00	2,305,500.00	
	3.5 BEL GOVT 110328	100,000.00	103,700.00	
	3.5 BEL GOVT 150328	1,500,000.00	1,527,450.00	
	3.5 BTAN 110712	5,000,000.00	5,208,000.00	
	3.5 BUND 160104	7,100,000.00	7,370,013.00	
	3.5 BUND 190704	2,700,000.00	2,736,423.00	
	3.5 ITALY GOVT 110315	4,600,000.00	4,759,666.00	
	3.5 ITALY GOVT 140601	1,400,000.00	1,421,280.00	
	3.5 O.A.T 150425	5,200,000.00	5,348,720.00	
	3.5 OBL 110408	7,000,000.00	7,279,930.00	
	3.5 OBL 111014	4,800,000.00	5,022,864.00	
	3.5 OBL 130412	4,300,000.00	4,515,559.00	
	3.6 HELLENIC GOVT 160720	2,100,000.00	2,047,920.00	
	3.7 HELLENIC GOVT 150720	2,300,000.00	2,288,960.00	
	3.75 BEL GOVT 150928	3,000,000.00	3,078,900.00	
	3.75 BTAN 100912	3,200,000.00	3,306,880.00	
	3.75 BTAN 120112	3,900,000.00	4,100,070.00	
	3.75 BTAN 130112	4,600,000.00	4,847,020.00	
	3.75 BUND 130704	5,700,000.00	6,030,543.00	
	3.75 BUND 150104	6,000,000.00	6,346,620.00	
	3.75 BUND 170104	5,200,000.00	5,433,792.00	
	3.75 BUND 190104	6,200,000.00	6,437,026.00	
	3.75 ITALY GOVT 110201	5,300,000.00	5,491,966.00	
	3.75 ITALY GOVT 110915	4,300,000.00	4,478,450.00	
	3.75 ITALY GOVT 131215	5,100,000.00	5,253,000.00	
	3.75 ITALY GOVT 150801	6,700,000.00	6,836,010.00	
	3.75 ITALY GOVT 160801	7,400,000.00	7,481,400.00	
	3.75 ITALY GOVT 210801	5,500,000.00	5,075,950.00	
	3.75 NETH GOVT 140715	3,400,000.00	3,547,900.00	
	3.75 NETH GOVT 230115	3,100,000.00	3,003,280.00	
	3.75 O.A.T 170425	5,100,000.00	5,232,600.00	
	3.75 O.A.T 210425	5,700,000.00	5,593,410.00	
	3.8 AUSTRIA GOVT 131020	3,200,000.00	3,331,840.00	
	3.8 HELLENIC GOVT 110320	2,200,000.00	2,275,460.00	
	3.8 SPAIN GOVT 170131	3,400,000.00	3,418,700.00	
	3.85 PORTUGUESE 210415	3,200,000.00	3,040,000.00	
	3.875 FINNISH GOVT170915	1,700,000.00	1,745,050.00	
	3.9 AUSTRIA GOVT 200715	2,700,000.00	2,633,850.00	
	3.9 HELLENIC GOVT 110820	2,000,000.00	2,077,200.00	
	3.9 SPAIN GOVT 121031	3,900,000.00	4,091,100.00	
	4 AUSTRIA GOVT 160915	2,600,000.00	2,656,680.00	
	4 BEL GOVT 130328	2,900,000.00	3,062,400.00	
	4 BEL GOVT 140328	2,800,000.00	2,947,840.00	
	4 BEL GOVT 170328	2,900,000.00	2,969,020.00	
	4 BEL GOVT 180328	2,600,000.00	2,639,260.00	
	4 BEL GOVT 190328	1,700,000.00	1,708,670.00	
	4 BEL GOVT 220328	2,600,000.00	2,563,600.00	
	4 BUND 160704	5,900,000.00	6,280,019.00	
	4 BUND 180104	5,100,000.00	5,401,206.00	
	4 BUND 370104	5,900,000.00	5,781,764.00	
	4 HELLENIC GOVT 130820	2,300,000.00	2,358,650.00	
	4 IRISH GOVT 140115	1,700,000.00	1,715,640.00	

通貨 種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
	4 ITALY GOVT 120415	4,200,000.00	4,407,480.00	
	4 ITALY GOVT 170201	5,500,000.00	5,606,700.00	
	4 ITALY GOVT 370201	5,800,000.00	4,818,640.00	
	4 NETH GOVT 110115	3,300,000.00	3,442,890.00	
	4 NETH GOVT 160715	2,900,000.00	3,026,440.00	
	4 NETH GOVT 180715	2,900,000.00	2,972,500.00	
	4 NETH GOVT 190715	3,600,000.00	3,661,920.00	
	4 NETH GOVT 370115	3,100,000.00	3,005,760.00	
	4 O.A.T 130425	5,200,000.00	5,514,600.00	
	4 O.A.T 131025	4,900,000.00	5,198,410.00	
	4 O.A.T 140425	4,900,000.00	5,194,490.00	
	4 O.A.T 141025	5,700,000.00	6,032,880.00	
	4 O.A.T 180425	5,500,000.00	5,676,000.00	
	4 O.A.T 381025	6,200,000.00	5,936,500.00	
	4 O.A.T 550425	3,900,000.00	3,704,610.00	
	4 OBL 120413	4,100,000.00	4,360,104.00	
	4 OBL 131011	4,100,000.00	4,383,228.00	
	4 SCHATS 100910	2,200,000.00	2,280,168.00	
	4.1 HELLENIC GOVT 120820	2,000,000.00	2,074,200.00	
	4.1 PORTUGUESE 370415	1,600,000.00	1,428,320.00	
	4.1 SPAIN GOVT 110430	4,000,000.00	4,180,000.00	
	4.1 SPAIN GOVT 180730	4,100,000.00	4,164,370.00	
	4.15 AUSTRIA GOVT 370315	1,800,000.00	1,674,180.00	
	4.2 PORTUGUESE 161015	1,300,000.00	1,327,950.00	
	4.2 SPAIN GOVT 130730	3,900,000.00	4,140,630.00	
	4.2 SPAIN GOVT 370131	3,500,000.00	3,227,350.00	
	4.25 BEL GOVT 130928	3,300,000.00	3,517,800.00	
	4.25 BEL GOVT 140928	3,100,000.00	3,290,030.00	
	4.25 BUND 140104	6,200,000.00	6,691,908.00	
	4.25 BUND 140704	6,500,000.00	7,035,340.00	
	4.25 BUND 170704	4,900,000.00	5,280,485.00	
	4.25 BUND 180704	5,500,000.00	5,932,465.00	
	4.25 BUND 390704	3,700,000.00	3,809,890.00	
	4.25 FINNISH GOVT 120915	1,600,000.00	1,707,680.00	
	4.25 FINNISH GOVT 150704	1,300,000.00	1,388,270.00	
	4.25 ITALY GOVT 110901	4,100,000.00	4,309,100.00	
	4.25 ITALY GOVT 121015	4,700,000.00	4,958,030.00	
	4.25 ITALY GOVT 130415	4,300,000.00	4,526,180.00	
	4.25 ITALY GOVT 130801	6,500,000.00	6,851,000.00	
	4.25 ITALY GOVT 140801	6,400,000.00	6,725,120.00	
	4.25 ITALY GOVT 150201	5,500,000.00	5,760,150.00	
	4.25 ITALY GOVT 190201	6,000,000.00	6,036,600.00	
	4.25 ITALY GOVT 190901	2,900,000.00	2,873,900.00	
	4.25 NETH GOVT 130715	3,900,000.00	4,173,000.00	
	4.25 O.A.T 171025	4,800,000.00	5,061,120.00	
	4.25 O.A.T 181025	4,600,000.00	4,819,880.00	
	4.25 O.A.T 190425	7,100,000.00	7,401,040.00	
	4.25 O.A.T 231025	4,200,000.00	4,260,060.00	
	4.25 OBL 121012	4,100,000.00	4,402,293.00	
	4.25 SPAIN GOVT 140131	2,700,000.00	2,869,020.00	
	4.3 AUSTRIA GOVT 140715	2,500,000.00	2,637,750.00	
	4.3 AUSTRIA GOVT 170915	1,700,000.00	1,757,630.00	
	4.3 HELLENIC GOVT 120320	3,200,000.00	3,342,720.00	
	4.3 HELLENIC GOVT 170720	3,000,000.00	2,979,000.00	
	4.3 SPAIN GOVT 191031	1,700,000.00	1,722,440.00	
	4.35 AUSTRIA GOVT 190315	2,000,000.00	2,041,600.00	
	4.35 PORTUGUESE 171016	1,700,000.00	1,730,600.00	
	4.375 FINNISH GOV 190704	1,300,000.00	1,365,780.00	
	4.375 PORTUGUESE 140616	1,700,000.00	1,795,880.00	
	4.4 IRISH GOVT 190618	1,200,000.00	1,107,960.00	
	4.4 SPAIN GOVT 150131	3,700,000.00	3,941,610.00	
	4.45 PORTUGUESE 180615	1,600,000.00	1,627,680.00	
	4.5 BTAN 120712	3,600,000.00	3,867,120.00	
	4.5 BTAN 130712	3,100,000.00	3,345,830.00	
	4.5 BUND 130104	6,100,000.00	6,600,200.00	
	4.5 HELLENIC GOVT 140520	2,700,000.00	2,814,750.00	
	4.5 HELLENIC GOVT 370920	2,300,000.00	1,934,990.00	
	4.5 IRISH GOVT 181018	1,600,000.00	1,521,760.00	
	4.5 IRISH GOVT 200418	1,200,000.00	1,126,080.00	
	4.5 ITALY GOVT 100801	4,600,000.00	4,769,004.00	

通貨 種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
	4.5 ITALY GOVT 180201	5,500,000.00	5,693,050.00	
	4.5 ITALY GOVT 180801	5,000,000.00	5,132,000.00	
	4.5 ITALY GOVT 190301	5,800,000.00	5,907,880.00	
	4.5 ITALY GOVT 200201	5,500,000.00	5,546,750.00	
	4.5 NETH GOVT 170715	3,200,000.00	3,413,440.00	
	4.5 O.A.T 410425	1,300,000.00	1,350,050.00	
	4.6 HELLENIC GOVT 130520	2,200,000.00	2,313,080.00	
	4.6 HELLENIC GOVT 180720	2,100,000.00	2,097,690.00	
	4.6 HELLENIC GOVT 400920	2,000,000.00	1,677,400.00	
	4.6 IRISH GOVT 160418	1,600,000.00	1,600,320.00	
	4.6 SPAIN GOVT 190730	3,300,000.00	3,449,160.00	
	4.65 AUSTRIA GOVT 180115	2,700,000.00	2,847,420.00	
	4.7 HELLENIC GOVT 240320	2,700,000.00	2,499,120.00	
	4.75 BUND 280704	3,000,000.00	3,228,420.00	
	4.75 BUND 340704	5,200,000.00	5,629,624.00	
	4.75 BUND 400704	2,000,000.00	2,227,540.00	
	4.75 ITALY GOVT 130201	5,400,000.00	5,781,240.00	
	4.75 ITALY GOVT 230801	4,300,000.00	4,272,910.00	
	4.75 O.A.T 121025	5,100,000.00	5,528,400.00	
	4.75 O.A.T 350425	4,100,000.00	4,392,330.00	
	4.75 PORTUGUESE 190614	1,200,000.00	1,240,800.00	
	4.75 SPAIN GOVT 140730	3,600,000.00	3,908,520.00	
	4.8 SPAIN GOVT 240131	2,100,000.00	2,164,890.00	
	4.9 SPAIN GOVT 400730	3,200,000.00	3,322,240.00	
	5 AUSTRIA GOVT 120715	2,600,000.00	2,813,720.00	
	5 BEL GOVT 110928	4,000,000.00	4,296,800.00	
	5 BEL GOVT 120928	3,300,000.00	3,594,360.00	
	5 BEL GOVT 350328	3,500,000.00	3,753,750.00	
	5 BUND 110704	9,000,000.00	9,641,610.00	
	5 BUND 120104	7,100,000.00	7,685,324.00	
	5 BUND 120704	6,900,000.00	7,528,728.00	
	5 IRISH GOVT 130418	1,600,000.00	1,689,920.00	
	5 ITALY GOVT 120201	7,900,000.00	8,474,330.00	
	5 ITALY GOVT 340801	5,100,000.00	4,990,350.00	
	5 ITALY GOVT 390801	4,800,000.00	4,584,480.00	
	5 NETH GOVT 110715	4,200,000.00	4,500,300.00	
	5 NETH GOVT 120715	3,300,000.00	3,597,000.00	
	5 O.A.T 111025	4,200,000.00	4,522,140.00	
	5 O.A.T 120425	4,400,000.00	4,776,640.00	
	5 O.A.T 161025	5,600,000.00	6,222,720.00	
	5 PORTUGUESE 120615	1,800,000.00	1,936,260.00	
	5 SPAIN GOVT 120730	3,300,000.00	3,577,860.00	
	5.15 PORTUGUESE 110615	1,300,000.00	1,381,900.00	
	5.25 AUSTRIA GOVT 110104	2,100,000.00	2,224,110.00	
	5.25 BUND 100704	7,700,000.00	8,032,948.00	
	5.25 BUND 110104	7,500,000.00	7,964,550.00	
	5.25 HELLENIC GOVT120518	2,100,000.00	2,248,470.00	
	5.25 ITALY GOVT 110801	5,800,000.00	6,211,220.00	
	5.25 ITALY GOVT 170801	5,400,000.00	5,910,300.00	
	5.25 ITALY GOVT 291101	7,000,000.00	7,104,300.00	
	5.35 HELLENIC GOVT110518	2,000,000.00	2,126,200.00	
	5.35 SPAIN GOVT 111031	3,200,000.00	3,462,080.00	
	5.375 FINNISH GOVT130704	1,500,000.00	1,669,500.00	
	5.4 SPAIN GOVT 110730	4,000,000.00	4,307,600.00	
	5.45 PORTUGUESE 130923	1,900,000.00	2,092,470.00	
	5.5 BEL GOVT 170928	2,200,000.00	2,473,900.00	
	5.5 BEL GOVT 280328	3,100,000.00	3,510,750.00	
	5.5 BUND 310104	4,300,000.00	5,062,046.00	
	5.5 HELLENIC GOVT 140820	3,100,000.00	3,356,060.00	
	5.5 ITALY GOVT 101101	5,800,000.00	6,129,382.00	
	5.5 NETH GOVT 100715	3,200,000.00	3,347,520.00	
	5.5 NETH GOVT 280115	2,300,000.00	2,656,500.00	
	5.5 O.A.T 101025	11,400,000.00	12,057,780.00	
	5.5 O.A.T 290425	4,300,000.00	4,984,130.00	
	5.5 SPAIN GOVT 170730	3,900,000.00	4,383,600.00	
	5.625 BUND 280104	3,700,000.00	4,371,180.00	
	5.75 BEL GOVT 100928	6,000,000.00	6,339,600.00	
	5.75 FINNISH GOVT 110223	2,400,000.00	2,574,240.00	
	5.75 ITALY GOVT 330201	4,000,000.00	4,255,600.00	
	5.75 O.A.T 321025	4,700,000.00	5,688,880.00	

通貨種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
	5.75 SPAIN GOVT 320730	3,400,000.00	3,887,900.00	
	5.9 HELLENIC GOVT 221022	2,200,000.00	2,355,980.00	
	6 HELLENIC GOVT 190719	3,900,000.00	4,212,390.00	
	6 ITALY GOVT 310501	7,600,000.00	8,315,920.00	
	6 O.A.T 251025	2,800,000.00	3,399,760.00	
	6 SPAIN GOVT 290131	4,100,000.00	4,771,170.00	
	6.15 SPAIN GOVT 130131	3,500,000.00	3,948,000.00	
	6.25 AUSTRIA GOVT 270715	1,700,000.00	2,032,520.00	
	6.25 BUND 240104	2,800,000.00	3,512,936.00	
	6.25 BUND 300104	2,400,000.00	3,051,288.00	
	6.5 BUND 270704	2,900,000.00	3,751,150.00	
	6.5 HELLENIC GOVT 191022	2,100,000.00	2,373,420.00	
	6.5 ITALY GOVT 271101	6,800,000.00	7,859,440.00	
	6.5 O.A.T 110425	7,500,000.00	8,189,250.00	
	7.25 ITALY GOVT 261101	2,400,000.00	2,988,240.00	
	8 BEL GOVT 121224	2,000,000.00	2,366,400.00	
	8 BEL GOVT 150328	1,800,000.00	2,247,300.00	
	8.5 O.A.T 121226	1,400,000.00	1,694,140.00	
	8.5 O.A.T 191025	2,500,000.00	3,519,250.00	
	8.5 O.A.T 230425	2,800,000.00	4,090,520.00	
	9 ITALY GOVT 231101	3,000,000.00	4,269,000.00	
	国債証券 小計	883,200,000.00	929,327,868.00 (123,024,423,165)	
ユーロ 小計		883,200,000.00	929,327,868.00 (123,024,423,165)	
合計			232,309,287,254 (232,309,287,254)	

(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 141銘柄	100.00%	31.39%
カナダドル	国債証券 26銘柄	100.00%	2.53%
オーストラリアドル	国債証券 10銘柄	100.00%	0.61%
イギリスポンド	国債証券 32銘柄	100.00%	8.15%
スイスフラン	国債証券 11銘柄	100.00%	0.73%
シンガポールドル	国債証券 16銘柄	100.00%	0.42%
マレーシアリングット	国債証券 8銘柄	100.00%	0.53%
スウェーデンクローネ	国債証券 9銘柄	100.00%	0.67%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	100.00%	0.28%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.00%	0.86%
ポーランドズロチ	国債証券 10銘柄	100.00%	0.86%
ユーロ	国債証券 237銘柄	100.00%	52.96%

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

「注記表(デリバティブ取引等関係に関する注記)」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21年7月31日現在
(単位：円)

資産総額	1,793,236,551
負債総額	17,882,825
純資産総額(-)	1,775,353,726
発行済口数	2,135,505,171 口
1口当たり純資産価額(/)	0.8314 (1万口当たり 8,314)

<参考>

「三菱UFJ 外国債券マザーファンド」の現況
純資産額計算書

平成21年7月31日現在
(単位：円)

資産総額	242,455,349,522
負債総額	803,458,850
純資産総額(-)	241,651,890,672
発行済口数	129,407,298,436 口
1口当たり純資産価額(/)	1.8674 (1万口当たり 18,674)

第5【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

第三部【特別情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額等

平成21年8月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、124,098株を発行済です。

(2) 委託会社の機構

・会社の意思決定機構

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

・投資運用の意思決定機構

投資環境見通しの策定

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

運用戦略の決定

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

運用計画の決定

で決定されたファンド毎の運用戦略に基づいて、各運用部は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戦略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（5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平成21年8月末現在のものであり、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用

業)等を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。
平成21年8月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。(親投資信託を除きます。)

商品分類	本数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	330	5,512,395
追加型公社債投資信託	18	436,082
単位型株式投資信託	10	95,352
単位型公社債投資信託	6	79,257
合計	364	6,123,085

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

3【委託会社等の経理状況】

（１）財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱UFJ投信株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」（以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年内閣府令第52号）」に基づき作成しております。

第23期事業年度（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）は、改正前の財務諸表等規則に基づき、第24期事業年度（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）は、改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

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

（２）監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第23期事業年度（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）及び第24期事業年度（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）の財務諸表について、監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

区 分	注記 番号	第23期 (平成20年3月31日現在)		第24期 (平成21年3月31日現在)	
		金 額 (千円)	構成比(%)	金 額 (千円)	構成比(%)
(資産の部)					
流動資産					
現金及び預金	2	13,048,512		8,398,952	
有価証券	2	7,000,000		11,498,934	
前払費用		176,784		130,052	
未収入金		754,110		133,300	
未収委託者報酬		5,719,241		3,496,056	
未収収益	2	9,851		77,468	
繰延税金資産		470,611		289,685	
金銭の信託	2	1,000,000		1,000,000	
その他		2,358		13,229	
流動資産 計		28,181,470	58.4	25,037,680	57.8
固定資産					
有形固定資産					
建物	1	378,922		368,327	
器具備品	1	165,354		168,906	
土地		1,205,031		1,205,031	
		1,749,308	3.6	1,742,265	4.0
無形固定資産					
電話加入権		15,822		15,822	
ソフトウェア		833,346		809,683	
ソフトウェア仮勘定		-		7,316	
その他		200		156	
		849,369	1.8	832,978	1.9
投資その他の資産					
長期性預金	2	-		2,000,000	
投資有価証券		15,643,182		11,906,934	
関係会社株式		481,812		431,812	
長期差入保証金	2	844,628		844,978	
長期前払費用		44,419		4,371	
繰延税金資産		437,600		473,766	
その他		20,485		20,485	
		17,472,127	36.2	15,682,348	36.2
固定資産 計		20,070,805	41.6	18,257,593	42.2
資産合計		48,252,276	100.0	43,295,274	100.0

区 分	注記 番号	第23期 (平成20年3月31日現在)		第24期 (平成21年3月31日現在)	
		金 額 (千円)	構成比(%)	金 額 (千円)	構成比(%)
(負債の部)					
流動負債					
預り金		123,164		1,038,438	
未払金					
未払収益分配金		259,035		272,705	
未払償還金		2,234,769		2,047,207	
未払手数料	2	2,414,475		1,440,183	
その他未払金		122,624		110,716	
未払費用	2	1,190,361		781,556	
未払消費税等		150,778		-	
未払法人税等		3,063,071		595,981	
仮受金		9		43	
賞与引当金		473,000		478,200	
流動負債計			10,031,290		6,765,032
					15.6
固定負債					
長期未払金		40,175		-	
退職給付引当金		13,752		13,304	
役員退職慰労引当金		80,428		54,658	
固定負債計			134,355		67,962
					0.2
負債合計			10,165,645		6,832,995
					15.8
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			2,000,131		2,000,131
					4.6
資本剰余金					
資本準備金		222,096		222,096	
資本剰余金合計			222,096		222,096
					0.5
利益剰余金					
利益準備金		342,589		342,589	
その他利益剰余金					
別途積立金		6,998,000		6,998,000	
繰越利益剰余金		28,643,217		27,520,492	
利益剰余金合計			35,983,807		34,861,082
					80.5
株主資本合計			38,206,035		37,083,309
					85.7
評価・換算差額等					
その他有価証券評価差額金			119,404		621,031
					1.4
純資産合計			38,086,630		36,462,278
					84.2
負債純資産合計			48,252,276		43,295,274
					100.0

(2)【損益計算書】

区 分	注記 番号	第23期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)		第24期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	
		金 額 (千円)	百分比(%)	金 額 (千円)	百分比(%)
営業収益					
委託者報酬		53,528,583		42,137,383	
その他営業収益					
投資顧問料		17,390		7,887	
その他		9,522		8,381	
			53,555,496	100.0	42,153,652
営業費用					
支払手数料	2	23,552,779		18,452,482	
広告宣伝費		1,256,792		911,798	
公告費		4,837		4,088	
調査費					
調査費		708,443		778,991	
委託調査費		5,547,898		4,427,117	
事務委託費		248,027		229,877	
営業雑経費					
通信費		119,248		114,009	
印刷費		675,259		640,249	
協会費		43,595		42,295	
諸会費		6,863		6,356	
事務機器関連費		858,095		820,190	
			33,021,841	61.6	26,427,456
一般管理費					
給料					
役員報酬		176,700		171,783	
給料・手当		3,069,369		3,243,471	
賞与引当金繰入		473,000		478,200	
福利厚生費		383,722		427,372	
交際費		20,733		20,785	
旅費交通費		130,178		126,644	
租税公課		129,920		112,608	
不動産賃借料		666,879		658,309	
退職給付費用		116,927		151,382	
役員退職慰労引当金繰入		17,691		17,566	
固定資産減価償却費		289,851		345,975	
諸経費		348,524		368,982	
			5,823,499	10.9	6,123,082
営業利益			14,710,155	27.5	9,603,113
					22.8

		第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)			第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)		
区 分	注記 番号	金 額 (千円)		百分比(%)	金 額 (千円)		百分比(%)
営業外収益							
受取配当金		125,221			185,609		
有価証券利息	2	44,838			55,030		
受取利息	2	41,460			21,926		
有価証券償還益		-			-		
収益分配金等時効 完成分		227,953			111,003		
その他		5,113	444,587	0.8	5,225	378,796	0.9
営業外費用							
収益分配金等時効 完成分支払額		46,433			62,259		
事務過誤費		9,859			13,871		
その他		1,969	58,263	0.1	7,266	83,398	0.2
経常利益			15,096,480	28.2		9,898,511	23.5
特別利益							
投資有価証券売却益		1,279,301	1,279,301	2.4	15,399	15,399	0.0
特別損失							
投資有価証券売却損		429,258			228,868		
投資有価証券評価損		-			2,124,730		
固定資産除却損	1	2,713			2,488		
投資有価証券清算損		21,312			-		
移転関連費用		13,467			-		
造作変更費用		3,330			-		
その他		-	470,081	0.9	5,965	2,362,053	5.6
税引前当期純利益			15,905,700	29.7		7,551,856	17.9
法人税、住民税及び 事業税		6,282,766			3,801,688		
法人税等調整額		181,272	6,464,038	12.1	144,759	3,946,448	9.4
当期純利益			9,441,661	17.6		3,605,408	8.6

(3)【株主資本等変動計算書】

第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本							株主資本 合計	評価・換算 差額等 その他 有価証券 評価 差額金	純資産 合計
	資本金	資本剰余金		利益 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計			
		資本 準備金	資本 剰余金 合計		その他 利益剰余金					
					別途 積立金	繰越利益 剰余金				
前事業年度末 残高	2,000,131	222,096	222,096	342,589	6,998,000	23,917,280	31,257,870	33,480,097	1,829,438	35,309,536
事業年度中の 変動額										
剰余金の配当						△ 4,715,724	△ 4,715,724	△ 4,715,724		△ 4,715,724
当期純利益						9,441,661	9,441,661	9,441,661		9,441,661
株主資本以外の 項目の事業年度 中の変動額(純額)									△ 1,948,843	△ 1,948,843
事業年度中の 変動額合計	-	-	-	-	-	4,725,937	4,725,937	4,725,937	△ 1,948,843	2,777,093
当事業年度末 残高	2,000,131	222,096	222,096	342,589	6,998,000	28,643,217	35,983,807	38,206,035	△ 119,404	38,086,630

第24期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本							株主資本 合計	評価・換算 差額等 その他 有価証券 評価 差額金	純資産 合計
	資本金	資本剰余金		利益 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計			
		資本 準備金	資本 剰余金 合計		その他 利益剰余金					
					別途 積立金	繰越利益 剰余金				
前事業年度末 残高	2,000,131	222,096	222,096	342,589	6,998,000	28,643,217	35,983,807	38,206,035	△ 119,404	38,086,630
事業年度中の 変動額										
剰余金の配当						△ 4,728,133	△ 4,728,133	△ 4,728,133		△ 4,728,133
当期純利益						3,605,408	3,605,408	3,605,408		3,605,408
株主資本以外の 項目の事業年度中 の変動額(純額)									△ 501,627	△ 501,627
事業年度中の 変動額合計	-	-	-	-	-	△ 1,122,725	△ 1,122,725	△ 1,122,725	△ 501,627	△ 1,624,352
当事業年度末 残高	2,000,131	222,096	222,096	342,589	6,998,000	27,520,492	34,861,082	37,083,309	△ 621,031	36,462,278

重要な会計方針

項 目	第23期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第24期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	子会社株式：移動平均法による原価法によっております。 その他有価証券： 時価のあるものは決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)によっております。 時価のないものは移動平均法による原価法によっております。	同 左
2. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産 (2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェア それ以外の無形固定資産	定率法を採用しております。 なお、主な耐用年数は、建物 38年であります。 (会計方針の変更) 法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成19年4月1日以降に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。 これに伴う、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。 社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。	同 左 同 左
3. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。	同 左
4. 引当金の計上基準 (1) 賞与引当金 (2) 退職給付引当金 (3) 役員退職慰労引当金	従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 数理計算上の差異は、その発生年度の従業員の平均支払期間以内の一定の年数(8年)による定額法により、翌事業年度より費用処理することとしております。 役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。	同 左 同 左
5. 消費税等の会計処理	税抜方式によっております。	同 左

表示方法の変更

第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
(貸借対照表) 前事業年度まで「現金及び預金」に表示しておりました譲渡性預金(当事業年度末7,000,000千円)は、「金融商品会計に関する実務指針」(会計制度委員会報告第14号 最終改正平成20年3月25日)及び「金融商品会計に関するQ & A」(会計制度委員会 最終改正平成20年3月25日)が改正されたことに伴い、当事業年度より「有価証券」として表示しております。	

注記事項

(貸借対照表関係)

項目	第23期 (平成20年3月31日現在)	第24期 (平成21年3月31日現在)
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物 78,764千円 器具備品 88,022千円	建物 117,264千円 器具備品 130,206千円
2.関係会社に対する主な資産・負債	区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。 預金 9,365,450千円 有価証券 7,000,000千円 未収収益 5,253千円 金銭の信託 1,000,000千円 長期差入保証金 837,940千円 未払手数料 1,365,738千円 未払費用 259,919千円	区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。 預金 5,493,354千円 有価証券 11,000,000千円 未収収益 5,233千円 金銭の信託 1,000,000千円 長期性預金 2,000,000千円 長期差入保証金 837,940千円 未払手数料 868,907千円 未払費用 198,857千円

(損益計算書関係)

項目	第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
1.固定資産除却損の内訳	器具備品 2,713千円	器具備品 1,961千円 ソフトウエア 527千円
2.関係会社に対する主な取引	区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。 支払手数料 15,834,106千円 有価証券利息 32,637千円 受取利息 38,093千円	区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。 支払手数料 12,493,304千円 有価証券利息 44,704千円 受取利息 21,926千円

(株主資本等変動計算書関係)

第23期(自平成19年4月1日至平成20年3月31日)

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

	前事業年度末 株式数(株)	当事業年度増加 株式数(株)	当事業年度減少 株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
発行済株式				
普通株式	124,098	-	-	124,098
合計	124,098	-	-	124,098

2.配当に関する事項

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
平成20年6月30日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	4,728,133千円
1株当たり配当額	38,100円
基準日	平成20年3月31日
効力発生日	平成20年7月1日

第24期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

	前事業年度末 株式数(株)	当事業年度増加 株式数(株)	当事業年度減少 株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
発行済株式				
普通株式	124,098	-	-	124,098
合計	124,098	-	-	124,098

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成20年6月30日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額 4,728,133千円

1株当たり配当額 38,100円

基準日 平成20年3月31日

効力発生日 平成20年7月1日

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

平成21年6月29日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額 1,811,830千円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 14,600円

基準日 平成21年3月31日

効力発生日 平成21年6月30日

(有価証券関係)

第23期(平成20年3月31日現在)

1. その他有価証券で時価のあるもの

	種類	取得原価 (千円)	貸借対照表計上額 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株式等			
	債券			
	その他	1,783,231	2,083,831	300,599
	小計	1,783,231	2,083,831	300,599
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株式等			
	債券			
	その他	10,833,157	10,193,313	639,843
	小計	10,833,157	10,193,313	639,843
	合計	12,616,389	12,277,145	339,243

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券(自平成19年4月1日至平成20年3月31日)

売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
7,602,413	1,279,301	429,258

3. 時価評価されていない主な有価証券の内容

	貸借対照表計上額
その他有価証券	
MMF	2,009,213千円
キャッシュファンド	1,005,546千円
譲渡性預金	7,000,000千円
非上場株式	351,277千円
子会社株式及び関連会社株式	
子会社株式	481,812千円

4. その他有価証券のうち満期があるものの今後の償還予定

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
投資信託	-	782,596	-	-
合 計	-	782,596	-	-

第24期(平成21年3月31日現在)

1. その他有価証券で時価のあるもの

	種類	取得原価 (千円)	貸借対照表計上額 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株式等			
	債券 その他	1,465,168	1,522,867	57,698
	小 計	1,465,168	1,522,867	57,698
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株式等			
	債券 その他	8,557,951	7,573,200	984,750
	小 計	8,557,951	7,573,200	984,750
合 計		10,023,119	9,096,067	927,052

(注) 当事業年度において、有価証券について2,124,730千円（その他有価証券で時価のある証券投資信託2,124,730千円）減損処理を行っております。なお、証券投資信託の減損処理は、期末における時価が簿価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）

売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
1,729,081	15,399	228,868

3. 時価評価されていない主な有価証券の内容

	貸借対照表計上額
その他有価証券	
MMF	2,014,549千円
キャッシュファンド	1,008,475千円
譲渡性預金	11,000,000千円
非上場株式	286,777千円
子会社株式及び関連会社株式	
子会社株式	431,812千円

4. その他有価証券のうち満期があるものの今後の償還予定

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
投資信託	498,934	2,262,320	482,062	-
合 計	498,934	2,262,320	482,062	-

(デリバティブ取引関係)

第23期(自平成19年4月1日至平成20年3月31日)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

第24期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

1.採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、従業員に対して適格退職年金制度及び退職一時金制度を設けております。なお、平成18年6月に適格退職年金制度及び退職一時金制度の一部について確定拠出年金制度へ移行しました。

2.退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

	第23期 （平成20年3月31日現在）	第24期 （平成21年3月31日現在）
(1) 退職給付債務	858,846	771,109
(2) 年金資産	<u>727,035</u>	<u>454,977</u>
(3) 未積立退職給付債務 (1)+(2)	131,810	316,132
(4) 未認識数理計算上の差異	<u>162,154</u>	<u>306,966</u>
(5) 貸借対照表計上額純額 (3)+(4)	30,344	9,164
(6) 前払年金費用	<u>44,096</u>	<u>4,139</u>
(7) 退職給付引当金 (5)-(6)	<u>13,752</u>	<u>13,304</u>

3.退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

	第23期 （自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）	第24期 （自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）
(1) 勤務費用	22,905	29,439
(2) 利息費用	13,963	12,676
(3) 期待運用収益	14,624	10,905
(4) 数理計算上の差異の費用処理額	<u>17,916</u>	<u>38,186</u>
(5) 退職給付費用	<u>40,160</u>	<u>69,396</u>
(6) その他	<u>76,767</u>	<u>81,986</u>
(7) 合計	<u>116,927</u>	<u>151,382</u>

（注）銀行0Bの退職給付費用は、勤務費用に計上しております。

「（6）その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

4.退職給付の計算基礎に関する事項

	第23期 （平成20年3月31日現在）	第24期 （平成21年3月31日現在）
(1) 割引率	1.5%	同左
(2) 期待運用収益率	1.5%	同左
(3) 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準	同左
(4) 数理計算上の差異の処理年数	各事業年度の発生時における 従業員の平均支払期間以内の 一定の年数（8年）による定額 法により、翌事業年度より費 用処理しております。	同左

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位：千円)

	第23期 (平成20年3月31日現在)	第24期 (平成21年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	700,082	689,220
投資有価証券評価損	252,334	1,041,250
ゴルフ会員権評価損	40,922	30,885
未払事業税	232,055	49,084
賞与引当金	192,463	194,579
役員退職慰労引当金	32,726	22,240
退職給付引当金	5,595	5,413
退職一時金未払	32,694	14,992
減価償却超過額	5,615	63,725
委託者報酬	89,452	124,519
その他有価証券評価差額金	138,038	377,217
その他	31,340	32,298
繰延税金資産 小計	1,753,321	2,645,429
評価性引当額	827,166	1,880,292
繰延税金資産 合計	926,154	765,137
繰延税金負債		
前払年金費用	17,942	1,684
繰延税金負債 合計	17,942	1,684
繰延税金資産（負債）の純額	908,211	763,452

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異原因

第23期 (平成20年3月31日現在)	第24期 (平成21年3月31日現在)
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。	(%)
	法定実効税率 40.7
	(調整)
	投資有価証券評価損に係る損金不算入 11.4
	その他 0.2
	税効果会計適用後の法人税等の負担率 52.3

(関連当事者情報)

第23期(自平成19年4月1日至平成20年3月31日)

1. 親会社及び法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金	事業の内容	議決権等の被所有割合	関係内容		取引の内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社	三菱UFJ信託銀行㈱	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	直接 30.0%	兼任1人	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	5,882,050 千円	未払手数料	357,804 千円
							事務所の賃借	事務所敷金追加差入	43,826 千円	長期差入保証金	833,144 千円
							同上	事務所賃借料	643,380 千円		
							投資の助言	投資助言料	365,963 千円	未払費用	198,106 千円
その他の関係会社	㈱三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	996,973 百万円	銀行業	直接 15.0%	兼任1人	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	9,952,055 千円	未払手数料	1,007,933 千円
							取引銀行	譲渡性預金の預入	28,000,000 千円	有価証券	7,000,000 千円
								譲渡性預金に係る受取利息	32,637 千円	未収利息	5,253 千円
								株式の売却	1,296,000 千円		
								株式の売却	197,568 千円		

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

事務所敷金及び賃借料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。

預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。

株式の売却価額について、時価のあるものについては、市場実勢を勘案して決定しております。

株式の売却価額について、時価のないものについては、第三者機関による企業価値評価をもとに決定しております。

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

2. 兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金	事業の内容	議決権等の被所有割合	関係内容		取引の内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社の子会社	三菱UFJ証券㈱	東京都千代田区	65,518 百万円	証券業			当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	3,137,534 千円	未払手数料	643,244 千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

第24期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

(追加情報)

当事業年度より、「関連当事者の開示に関する会計基準」(企業会計基準第11号平成18年10月17日)及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第13号平成18年10月17日)を適用しております。

この結果、従来の開示対象に加えて、親会社に関する注記が開示対象に追加されております。

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高	
主要株主	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業、銀行業	直接 30.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	4,440,945 千円	未払手数料	239,286 千円	
							事務所の賃借	事務所賃借料	631,409 千円	長期差入保証金	833,144 千円
							投資の助言	投資助言料	264,141 千円	未払費用	146,190 千円
主要株主	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,196,295 百万円	銀行業	直接 15.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	8,052,358 千円	未払手数料	629,621 千円	
							取引銀行	譲渡性預金の預入	34,000,000 千円	有価証券	11,000,000 千円
								譲渡性預金に係る受取利息	44,704 千円	未収利息	3,900 千円
								マルチコーラブル預金の預入	3,000,000 千円	長期性預金	2,000,000 千円
								マルチコーラブル預金に係る受取利息	4,423 千円	未収利息	35 千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

事務所敷金及び賃借料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。

預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。

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

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ証券㈱	東京都千代田区	65,518百万円	証券業		当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	2,400,621千円	未払手数料	296,719千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

2.親会社に関する注記

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

(1株当たり情報)

項目	第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
1株当たり純資産額	306,907円68銭	293,818円41銭
1株当たり当期純利益	76,082円29銭	29,052円91銭

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

1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

項目	第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
当期純利益 (千円)	9,441,661	3,605,408
普通株式に帰属しない金額 (千円)		
普通株式に係る当期純利益 (千円)	9,441,661	3,605,408
期中平均株式数 (株)	124,098	124,098

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下

において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

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

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

5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の特別決議が必要です。

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21年3月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (平成21年3月末現在)	事業の内容
イーバンク銀行株式会社	54,997 百万円	銀行業務を営んでいます。
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 (平成21年5月31日現在)	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	47,938 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。
ジョインベスト証券株式会社	21,400 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	7,445 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	4,208 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21年8月末現在）

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の30.0%（37,230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】

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21年5月1日 臨時報告書

平成21年4月17日 有価証券報告書、有価証券届出書

平成21年2月2日 臨時報告書

独立監査人の監査報告書

平成21年8月26日

三菱UFJ投信株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員
業務執行社員

公認会計士 荒川 進 印

指定社員
業務執行社員

公認会計士 鶴田光夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ世界国債インデックスファンド（毎月分配型）の平成21年1月20日から平成21年7月17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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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21年7月17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。

三菱UFJ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、財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年6月30日

三菱UFJ投信株式会社

取締役会 御中

監査法人 トーマツ

指定社員 業務執行社員	公認会計士	桃崎 有治 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	村山 周平 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	五十幡 理一郎 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ投信株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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投信株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。

独立監査人の監査報告書

平成21年2月26日

三菱UFJ投信株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員
業務執行社員

公認会計士 荒川 進 印

指定社員
業務執行社員

公認会計士 鶴田光夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ世界国債インデックスファンド（毎月分配型）の平成20年7月18日から平成21年1月19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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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21年1月19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。

三菱UFJ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、財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年6月30日

三菱UFJ投信株式会社

取締役会 御中

監査法人 トーマツ

指定社員 業務執行社員	公認会計士	桃崎 有治 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	村山 周平 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	五十幡 理一郎 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ投信株式会社の平成19年4月1日から平成20年3月31日までの第23期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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投信株式会社の平成20年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。