

**【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26年10月16日
【計算期間】	第15特定期間（自 平成26年1月18日 至 平成26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 金上 孝
【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】	井上 靖
【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、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに概ね連動することを目指して運用を行います。

信託金の限度額は、3,000億円です。

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

商品分類表

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

属性区分表

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

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

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

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

## 商品分類の定義

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

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

## 属性区分の定義

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

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

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

## [ ファンドの目的・特色 ]

## ファンドの目的

日本を除く世界各国の公社債を実質的な主要投資対象とし、日本を除く世界主要国の国債の指標であるシティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)の動きに概ね連動することをめざします。

## ファンドの特色

1

### 日本を除く世界各国の公社債を実質的な主要投資対象とします。

運用にあたっては、三菱UFJ外国債券マザーファンドを通じて、日本を除く世界各国の公社債への投資を行います。なお、公社債、短期金融商品に直接投資することがあります。

2

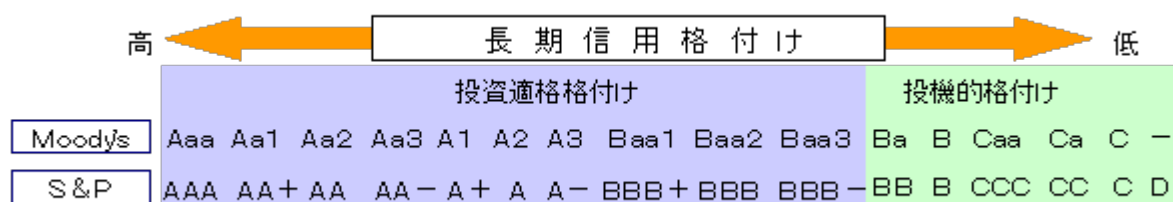
### シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)<sup>1</sup>の動きに概ね連動することをめざして運用を行います。

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマーク<sup>2</sup>とします。

- 1 シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。当該指数は、以下の22か国で構成されています(2014年7月末現在、国名は50音順)。ただし、構成国は変わる可能性があります。
- 2 ベンチマークとは、ファンドの運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指標です。



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



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

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

3

### 原則として為替ヘッジを行いません。

為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

ただし、市況動向の判断により、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。

4

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

毎月17日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないこともあります。また、分配金額は運用実績に応じて変動します。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

### 収益分配金に関する留意事項

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

投資信託で分配金が  
支払われるイメージ



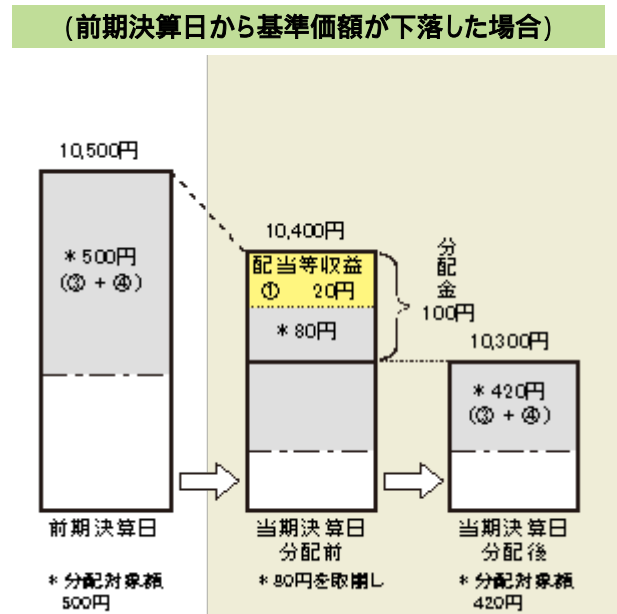
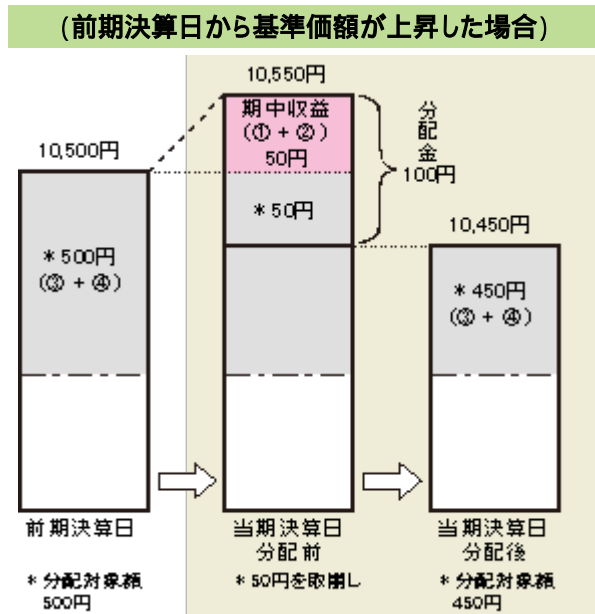
分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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

分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）



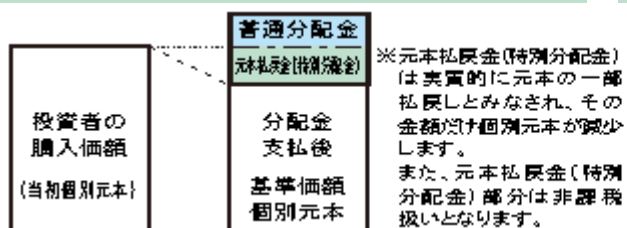
上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

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

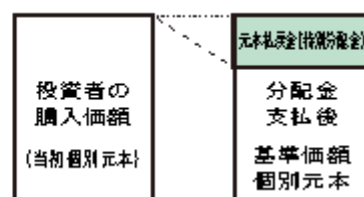
収益調整金：追加型投資信託で追加設定が行われることによって、既存の受益者への収益分配可能額が薄まらないようにするために設けられた勘定です。

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

（分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合）



（分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合）



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

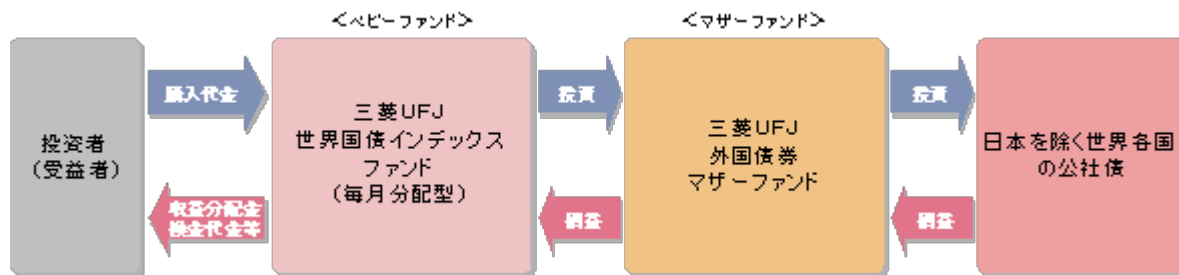
元本払戻金(特別分配金)：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

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



## &lt;ファンドの仕組み&gt;

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



## &lt;主な投資制限&gt;

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

## (2) 【ファンドの沿革】

平成19年4月19日 設定日、信託契約締結、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割

投資家（受益者）	
お申込金 収益分配金、解約代金等	
販売会社	募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。
お申込金 収益分配金、解約代金等	
受託会社（受託者） 三菱UFJ信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）	委託会社（委託者） 三菱UFJ投信株式会社
信託財産の保管・管理等を行います。	
投資 損益	
マザーファンド	
投資 損益	
有価証券等	
信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。	

## 委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「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26年7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26年7月末現在）

株主名	住所	所有株式数	所有比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	62,050株	50.0%
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	31,025株	25.0%
株式会社三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	31,023株	25.0%

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

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

三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに概ね連動することを目指して運用を行います。

受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

## (2)【投資対象】

## 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

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

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

2. 国債証券

3. 地方債証券
  4. 特別の法律により法人の発行する債券
  5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
  6. 資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
  7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
  8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
  9. 資産の流動化に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
  10. コマーシャル・ペーパー
  11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
  12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から11. の証券または証書の性質を有するもの
  13. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券
  14. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
  15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
  17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
  21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  22. 外国の者に対する権利で21. の有価証券の性質を有するもの
- なお、1. の証券または証書ならびに12. および17. の証券または証書のうち1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から6. までの証券ならびに12. および17. の証券または証書のうち2. から6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13. および14. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

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

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

その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・外国為替予約取引

#### <三菱UFJ 外国債券マザーファンドの概要>

（基本方針）

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

**（運用方法）****投資対象**

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

**投資態度**

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

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

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

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

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

**（投資制限）**

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

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

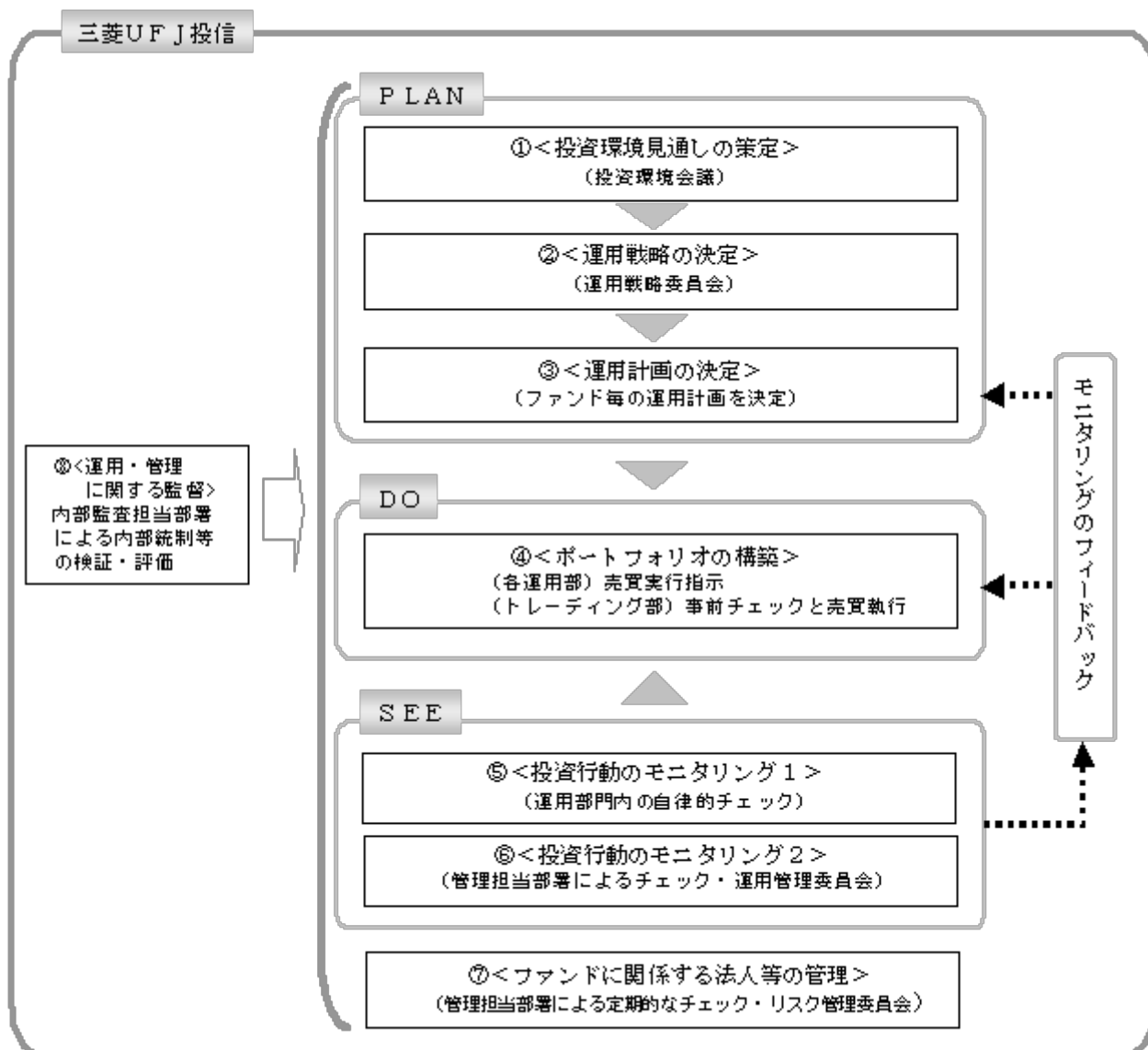
同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

## (3) 【運用体制】



## 投資環境見通しの策定

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

## 運用戦略の決定

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

## 運用計画の決定

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

## ポートフォリオの構築

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

## 投資行動のモニタリング1

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

## 投資行動のモニタリング2

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

## ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に関係する法人については、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、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

ち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

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

#### 同一銘柄の転換社債等

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

#### スワップ取引

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

#### 信用取引

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

#### 外国為替予約取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- b. a. の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- c. b. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- d. b. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

#### 公社債の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- b. a. の指図は、当該借入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

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

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

市場リスク

#### (価格変動リスク)

一般に、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動するため、当ファンドはその影響を受け公社債の価格が下落した場合には基準価額の下落により損失を被り、投資元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あり、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。そのため、為替相場が円高方向に進んだ場合には、基準価額の下落により損失を被り、投資元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

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリングオフ)の適用はありません。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・当ファンドは、シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)の動きに概ね連動することをめざして運用を行いますが、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、債券先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響、分配金を準備するためにファンド内に資金が滞留すること等の要因により乖離を生じることがあります。

## (2) 投資リスクに対する管理体制

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

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0.81% (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0.432% (税抜 年0.4%)	年0.324% (税抜 年0.3%)	年0.054% (税抜 年0.05%)
-----------------------	-----------------------	------------------------

信託報酬は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。

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

#### （４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

ご投資家のみなさまにご負担いただく手数料等の合計額については、お申込金額や保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

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

##### １．収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

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

##### ２．解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」の適用対象です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

#### 個別元本について

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

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

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

#### 収益分配金について

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

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

上記は平成26年7月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

平成26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	1,308,713,951	100.00
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		62,239	0.00
純資産総額		1,308,776,190	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26年7月31日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	三菱UFJ 外国債券マザー ファンド	親投資信託 受益証券		530,165,668	2.4478 2.4685	1,297,742,515 1,308,713,951		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26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26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)
第11計算期間末日 (平成20年 3月17日)	1,789,918,451 (分配付) 1,783,587,863 (分配落)	9,330 (分配付) 9,297 (分配落)
第12計算期間末日 (平成20年 4月17日)	1,843,765,021 (分配付) 1,837,456,398 (分配落)	9,643 (分配付) 9,610 (分配落)
第13計算期間末日 (平成20年 5月19日)	1,893,550,752 (分配付) 1,887,074,826 (分配落)	9,620 (分配付) 9,587 (分配落)
第14計算期間末日 (平成20年 6月17日)	1,903,431,919 (分配付) 1,896,958,037 (分配落)	9,700 (分配付) 9,667 (分配落)
第15計算期間末日 (平成20年 7月17日)	1,934,078,200 (分配付) 1,927,516,152 (分配落)	9,712 (分配付) 9,679 (分配落)
第16計算期間末日 (平成20年 8月18日)	1,955,050,662 (分配付) 1,948,454,852 (分配落)	9,781 (分配付) 9,748 (分配落)
第17計算期間末日 (平成20年 9月17日)	1,896,648,995 (分配付) 1,889,906,850 (分配落)	9,283 (分配付) 9,250 (分配落)
第18計算期間末日 (平成20年10月17日)	1,685,827,488 (分配付) 1,679,271,719 (分配落)	8,486 (分配付) 8,453 (分配落)
第19計算期間末日 (平成20年11月17日)	1,547,780,827 (分配付) 1,541,186,325 (分配落)	7,744 (分配付) 7,711 (分配落)
第20計算期間末日 (平成20年12月17日)	1,611,804,005 (分配付) 1,605,048,095 (分配落)	7,872 (分配付) 7,839 (分配落)
第21計算期間末日 (平成21年 1月19日)	1,610,187,566 (分配付) 1,603,354,849 (分配落)	7,776 (分配付) 7,743 (分配落)
第22計算期間末日 (平成21年 2月17日)	1,583,467,880 (分配付) 1,578,850,657 (分配落)	7,542 (分配付) 7,520 (分配落)
第23計算期間末日 (平成21年 3月17日)	1,709,950,565 (分配付) 1,705,325,135 (分配落)	8,116 (分配付) 8,094 (分配落)
第24計算期間末日 (平成21年 4月17日)	1,779,713,990 (分配付) 1,775,042,251 (分配落)	8,371 (分配付) 8,349 (分配落)
第25計算期間末日 (平成21年 5月18日)	1,715,866,130 (分配付) 1,711,175,585 (分配落)	8,030 (分配付) 8,008 (分配落)
第26計算期間末日 (平成21年 6月17日)	1,751,320,697 (分配付) 1,746,646,158 (分配落)	8,230 (分配付) 8,208 (分配落)
第27計算期間末日 (平成21年 7月17日)	1,756,500,096 (分配付) 1,751,788,097 (分配落)	8,177 (分配付) 8,155 (分配落)
第28計算期間末日 (平成21年 8月17日)	1,777,016,802 (分配付) 1,772,325,220 (分配落)	8,333 (分配付) 8,311 (分配落)
第29計算期間末日 (平成21年 9月17日)	1,773,101,462 (分配付) 1,768,375,184 (分配落)	8,232 (分配付) 8,210 (分配落)
第30計算期間末日 (平成21年10月19日)	1,804,803,633 (分配付) 1,799,995,332 (分配落)	8,252 (分配付) 8,230 (分配落)
第31計算期間末日 (平成21年11月17日)	1,777,904,731 (分配付) 1,773,133,722 (分配落)	8,180 (分配付) 8,158 (分配落)
第32計算期間末日 (平成21年12月17日)	1,764,594,756 (分配付) 1,759,780,512 (分配落)	8,055 (分配付) 8,033 (分配落)
第33計算期間末日 (平成22年 1月18日)	1,773,510,204 (分配付) 1,768,664,969 (分配落)	8,053 (分配付) 8,031 (分配落)
第34計算期間末日 (平成22年 2月17日)	1,743,667,645 (分配付) 1,738,760,703 (分配落)	7,818 (分配付) 7,796 (分配落)
第35計算期間末日 (平成22年 3月17日)	1,750,002,132 (分配付) 1,745,092,670 (分配落)	7,842 (分配付) 7,820 (分配落)
第36計算期間末日 (平成22年 4月19日)	1,756,128,023 (分配付) 1,751,228,121 (分配落)	7,885 (分配付) 7,863 (分配落)
第37計算期間末日 (平成22年 5月17日)	1,701,575,430 (分配付) 1,696,641,794 (分配落)	7,588 (分配付) 7,566 (分配落)
第38計算期間末日 (平成22年 6月17日)	1,687,201,360 (分配付) 1,682,241,736 (分配落)	7,484 (分配付) 7,462 (分配落)
第39計算期間末日 (平成22年 7月20日)	1,683,320,000 (分配付) 1,678,300,939 (分配落)	7,378 (分配付) 7,356 (分配落)

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

第70計算期間末日 (平成25年 2月18日)	1,627,759,249 (分配付) 1,624,618,064 (分配落)	8,291 (分配付) 8,275 (分配落)
第71計算期間末日 (平成25年 3月18日)	1,579,655,075 (分配付) 1,576,599,063 (分配落)	8,270 (分配付) 8,254 (分配落)
第72計算期間末日 (平成25年 4月17日)	1,581,483,173 (分配付) 1,578,585,274 (分配落)	8,732 (分配付) 8,716 (分配落)
第73計算期間末日 (平成25年 5月17日)	1,582,189,239 (分配付) 1,579,376,051 (分配落)	8,999 (分配付) 8,983 (分配落)
第74計算期間末日 (平成25年 6月17日)	1,399,461,074 (分配付) 1,396,778,502 (分配落)	8,347 (分配付) 8,331 (分配落)
第75計算期間末日 (平成25年 7月17日)	1,419,562,212 (分配付) 1,416,913,140 (分配落)	8,574 (分配付) 8,558 (分配落)
第76計算期間末日 (平成25年 8月19日)	1,373,638,406 (分配付) 1,371,026,035 (分配落)	8,413 (分配付) 8,397 (分配落)
第77計算期間末日 (平成25年 9月17日)	1,388,436,048 (分配付) 1,385,830,705 (分配落)	8,527 (分配付) 8,511 (分配落)
第78計算期間末日 (平成25年10月17日)	1,385,435,644 (分配付) 1,382,862,953 (分配落)	8,616 (分配付) 8,600 (分配落)
第79計算期間末日 (平成25年11月18日)	1,390,075,343 (分配付) 1,387,540,268 (分配落)	8,773 (分配付) 8,757 (分配落)
第80計算期間末日 (平成25年12月17日)	1,362,767,152 (分配付) 1,360,360,558 (分配落)	9,060 (分配付) 9,044 (分配落)
第81計算期間末日 (平成26年 1月17日)	1,302,753,667 (分配付) 1,300,473,269 (分配落)	9,141 (分配付) 9,125 (分配落)
第82計算期間末日 (平成26年 2月17日)	1,279,702,591 (分配付) 1,277,422,697 (分配落)	8,981 (分配付) 8,965 (分配落)
第83計算期間末日 (平成26年 3月17日)	1,298,766,843 (分配付) 1,296,479,256 (分配落)	9,084 (分配付) 9,068 (分配落)
第84計算期間末日 (平成26年 4月17日)	1,315,526,750 (分配付) 1,313,235,381 (分配落)	9,186 (分配付) 9,170 (分配落)
第85計算期間末日 (平成26年 5月19日)	1,310,399,636 (分配付) 1,308,107,921 (分配落)	9,149 (分配付) 9,133 (分配落)
第86計算期間末日 (平成26年 6月17日)	1,308,461,456 (分配付) 1,306,171,771 (分配落)	9,143 (分配付) 9,127 (分配落)
第87計算期間末日 (平成26年 7月17日)	1,301,784,071 (分配付) 1,299,507,924 (分配落)	9,151 (分配付) 9,135 (分配落)
平成25年 7月末日	1,384,008,752	8,470
8月末日	1,373,326,427	8,418
9月末日	1,374,564,533	8,517
10月末日	1,392,665,470	8,709
11月末日	1,396,683,998	8,992
12月末日	1,306,640,048	9,193
平成26年 1月末日	1,287,567,345	9,021
2月末日	1,295,063,703	9,059
3月末日	1,312,607,759	9,166
4月末日	1,316,448,844	9,189
5月末日	1,309,249,357	9,132
6月末日	1,303,862,864	9,143
7月末日	1,308,776,190	9,208



## 【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	33円
第2計算期間	33円
第3計算期間	33円
第4計算期間	33円
第5計算期間	33円
第6計算期間	33円
第7計算期間	33円
第8計算期間	33円
第9計算期間	33円
第10計算期間	33円
第11計算期間	33円
第12計算期間	33円
第13計算期間	33円
第14計算期間	33円
第15計算期間	33円
第16計算期間	33円
第17計算期間	33円
第18計算期間	33円
第19計算期間	33円
第20計算期間	33円
第21計算期間	33円
第22計算期間	22円
第23計算期間	22円
第24計算期間	22円
第25計算期間	22円
第26計算期間	22円
第27計算期間	22円
第28計算期間	22円
第29計算期間	22円
第30計算期間	22円
第31計算期間	22円
第32計算期間	22円
第33計算期間	22円
第34計算期間	22円
第35計算期間	22円
第36計算期間	22円
第37計算期間	22円
第38計算期間	22円
第39計算期間	22円
第40計算期間	22円
第41計算期間	22円
第42計算期間	22円
第43計算期間	16円
第44計算期間	16円
第45計算期間	16円
第46計算期間	16円
第47計算期間	16円
第48計算期間	16円
第49計算期間	16円
第50計算期間	16円
第51計算期間	16円
第52計算期間	16円
第53計算期間	16円
第54計算期間	16円
第55計算期間	16円

第56計算期間	16円
第57計算期間	16円
第58計算期間	16円
第59計算期間	16円
第60計算期間	16円
第61計算期間	16円
第62計算期間	16円
第63計算期間	16円
第64計算期間	16円
第65計算期間	16円
第66計算期間	16円
第67計算期間	16円
第68計算期間	16円
第69計算期間	16円
第70計算期間	16円
第71計算期間	16円
第72計算期間	16円
第73計算期間	16円
第74計算期間	16円
第75計算期間	16円
第76計算期間	16円
第77計算期間	16円
第78計算期間	16円
第79計算期間	16円
第80計算期間	16円
第81計算期間	16円
第82計算期間	16円
第83計算期間	16円
第84計算期間	16円
第85計算期間	16円
第86計算期間	16円
第87計算期間	16円

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	1.37
第2計算期間	0.14
第3計算期間	1.53
第4計算期間	6.34
第5計算期間	4.10
第6計算期間	2.25
第7計算期間	0.43
第8計算期間	0.13
第9計算期間	2.49
第10計算期間	1.09
第11計算期間	4.19
第12計算期間	3.72
第13計算期間	0.10
第14計算期間	1.17
第15計算期間	0.46
第16計算期間	1.05
第17計算期間	4.77
第18計算期間	8.25
第19計算期間	8.38
第20計算期間	2.08
第21計算期間	0.80
第22計算期間	2.59
第23計算期間	7.92
第24計算期間	3.42

第25計算期間	3.82
第26計算期間	2.77
第27計算期間	0.37
第28計算期間	2.18
第29計算期間	0.95
第30計算期間	0.51
第31計算期間	0.60
第32計算期間	1.26
第33計算期間	0.24
第34計算期間	2.65
第35計算期間	0.59
第36計算期間	0.83
第37計算期間	3.49
第38計算期間	1.08
第39計算期間	1.12
第40計算期間	0.28
第41計算期間	1.06
第42計算期間	1.22
第43計算期間	0.70
第44計算期間	2.08
第45計算期間	0.18
第46計算期間	0.64
第47計算期間	2.69
第48計算期間	5.86
第49計算期間	2.08
第50計算期間	0.46
第51計算期間	2.65
第52計算期間	1.22
第53計算期間	1.90
第54計算期間	0.42
第55計算期間	1.93
第56計算期間	1.37
第57計算期間	1.84
第58計算期間	4.96
第59計算期間	5.60
第60計算期間	3.15
第61計算期間	0.92
第62計算期間	0.83
第63計算期間	0.68
第64計算期間	0.26
第65計算期間	2.16
第66計算期間	0.91
第67計算期間	2.81
第68計算期間	4.95
第69計算期間	5.79
第70計算期間	4.88
第71計算期間	0.06
第72計算期間	5.79
第73計算期間	3.24
第74計算期間	7.08
第75計算期間	2.91
第76計算期間	1.69
第77計算期間	1.54
第78計算期間	1.23
第79計算期間	2.01
第80計算期間	3.46
第81計算期間	1.07
第82計算期間	1.57
第83計算期間	1.32

第84計算期間	1.30
第85計算期間	0.22
第86計算期間	0.10
第87計算期間	0.26

（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。

#### （４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	616,811,523	14,005,375	602,806,148
第2計算期間	501,542,683	104,923,889	999,424,942
第3計算期間	298,754,033	86,703,352	1,211,475,623
第4計算期間	318,627,631	60,223,691	1,469,879,563
第5計算期間	137,746,465	68,809,029	1,538,816,999
第6計算期間	64,243,587	72,014,044	1,531,046,542
第7計算期間	95,608,055	109,487,285	1,517,167,312
第8計算期間	142,626,542	27,193,273	1,632,600,581
第9計算期間	108,493,886	32,250,993	1,708,843,474
第10計算期間	136,378,482	51,021,977	1,794,199,979
第11計算期間	166,140,510	41,980,220	1,918,360,269
第12計算期間	109,539,096	115,822,354	1,912,077,011
第13計算期間	96,881,713	40,601,139	1,968,357,585
第14計算期間	73,317,078	79,436,076	1,962,238,587
第15計算期間	104,581,221	75,406,628	1,991,413,180
第16計算期間	74,718,355	67,401,126	1,998,730,409
第17計算期間	89,615,520	45,267,346	2,043,078,583
第18計算期間	95,394,118	151,868,836	1,986,603,865
第19計算期間	67,304,740	55,309,031	1,998,599,574
第20計算期間	72,640,287	23,619,856	2,047,620,005
第21計算期間	48,607,136	25,450,627	2,070,776,514
第22計算期間	45,151,635	16,519,045	2,099,409,104
第23計算期間	37,129,275	29,583,683	2,106,954,696
第24計算期間	42,005,705	22,938,427	2,126,021,974
第25計算期間	36,439,120	25,673,717	2,136,787,377
第26計算期間	51,692,037	60,410,986	2,128,068,428
第27計算期間	44,808,820	24,730,430	2,148,146,818
第28計算期間	37,587,959	53,197,124	2,132,537,653
第29計算期間	47,899,852	26,619,758	2,153,817,747
第30計算期間	52,221,798	18,920,129	2,187,119,416
第31計算期間	38,890,923	52,570,039	2,173,440,300
第32計算期間	63,251,965	45,939,348	2,190,752,917
第33計算期間	39,852,405	28,225,350	2,202,379,972
第34計算期間	63,921,739	35,873,127	2,230,428,584
第35計算期間	39,413,386	38,268,085	2,231,573,885
第36計算期間	46,618,143	50,963,707	2,227,228,321
第37計算期間	52,767,653	37,434,030	2,242,561,944
第38計算期間	34,241,337	22,428,506	2,254,374,775
第39計算期間	40,162,364	13,145,503	2,281,391,636
第40計算期間	27,282,038	14,137,164	2,294,536,510
第41計算期間	29,420,211	21,503,900	2,302,452,821
第42計算期間	26,283,107	32,187,843	2,296,548,085
第43計算期間	30,269,324	62,823,100	2,263,994,309
第44計算期間	25,487,613	39,011,980	2,250,469,942
第45計算期間	26,070,718	42,179,184	2,234,361,476
第46計算期間	26,140,310	28,155,987	2,232,345,799
第47計算期間	54,409,526	50,012,488	2,236,742,837
第48計算期間	34,055,092	48,398,870	2,222,399,059
第49計算期間	31,018,916	21,610,969	2,231,807,006

第50計算期間	25,697,843	14,619,061	2,242,885,788
第51計算期間	20,330,287	13,683,888	2,249,532,187
第52計算期間	25,752,732	39,313,469	2,235,971,450
第53計算期間	20,422,136	15,672,906	2,240,720,680
第54計算期間	17,786,289	23,052,854	2,235,454,115
第55計算期間	17,639,985	35,708,159	2,217,385,941
第56計算期間	19,204,198	23,862,039	2,212,728,100
第57計算期間	17,369,523	51,845,371	2,178,252,252
第58計算期間	17,873,825	43,336,334	2,152,789,743
第59計算期間	15,744,132	33,862,846	2,134,671,029
第60計算期間	16,734,024	16,951,220	2,134,453,833
第61計算期間	29,982,027	6,488,621	2,157,947,239
第62計算期間	18,361,721	12,958,132	2,163,350,828
第63計算期間	20,095,186	15,410,371	2,168,035,643
第64計算期間	22,230,119	17,718,470	2,172,547,292
第65計算期間	15,752,437	20,946,760	2,167,352,969
第66計算期間	14,626,256	18,427,926	2,163,551,299
第67計算期間	14,719,788	21,001,464	2,157,269,623
第68計算期間	20,798,987	49,691,771	2,128,376,839
第69計算期間	29,671,683	125,331,467	2,032,717,055
第70計算期間	17,404,428	86,880,792	1,963,240,691
第71計算期間	14,320,310	67,552,942	1,910,008,059
第72計算期間	17,905,200	116,726,045	1,811,187,214
第73計算期間	14,263,276	67,207,904	1,758,242,586
第74計算期間	14,477,880	96,112,903	1,676,607,563
第75計算期間	10,530,802	31,468,263	1,655,670,102
第76計算期間	11,906,354	34,844,268	1,632,732,188
第77計算期間	12,389,645	16,782,268	1,628,339,565
第78計算期間	11,168,006	31,575,361	1,607,932,210
第79計算期間	13,287,127	36,797,134	1,584,422,203
第80計算期間	13,525,838	93,826,657	1,504,121,384
第81計算期間	39,747,627	118,619,801	1,425,249,210
第82計算期間	12,634,094	12,949,365	1,424,933,939
第83計算期間	14,094,702	9,286,616	1,429,742,025
第84計算期間	18,840,956	16,476,760	1,432,106,221
第85計算期間	14,491,419	14,275,533	1,432,322,107
第86計算期間	11,558,246	12,826,656	1,431,053,697
第87計算期間	37,798,775	46,260,100	1,422,592,372

&lt; 参考 &gt;

「三菱UFJ 外国債券マザーファンド」

(1) 投資状況

平成26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	63,533,781,117	37.42
	フランス	17,893,637,294	10.54
	イタリア	17,770,699,713	10.47
	ドイツ	14,591,938,959	8.59
	イギリス	13,695,763,590	8.07
	スペイン	9,602,621,938	5.66
	オランダ	4,786,933,606	2.82
	ベルギー	4,724,271,123	2.78
	カナダ	3,795,483,793	2.24
	オーストリア	3,018,829,385	1.78
	オーストラリア	2,847,021,567	1.68
	メキシコ	1,819,654,932	1.07
	アイルランド	1,467,494,210	0.86
	デンマーク	1,362,617,533	0.80
	フィンランド	1,197,570,881	0.71
	ポーランド	1,174,753,381	0.69
	スウェーデン	954,001,827	0.56
	マレーシア	928,333,825	0.55
	南アフリカ	847,001,594	0.50
シンガポール	638,805,919	0.38	
スイス	598,470,984	0.35	
ノルウェー	489,470,161	0.29	
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		2,058,636,158	1.19
純資産総額		169,797,793,490	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26年7月31日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	券面総額	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
アメリカ	1.75 T-NOTE 230515	国債証券		8,700,000.00	9,710.48 9,703.2546	844,812,309 844,183,157	1.750000 2023/05/15	0.50
アメリカ	2.625 T-NOTE 201115	国債証券		7,400,000.00	10,704.43 10,620.0660	792,128,201 785,884,884	2.625000 2020/11/15	0.46
アメリカ	1.5 T-NOTE 180831	国債証券		7,300,000.00	10,358.92 10,270.5367	756,201,410 749,749,179	1.500000 2018/08/31	0.44
アメリカ	0.375 T-NOTE 160115	国債証券		6,700,000.00	10,309.50 10,297.8562	690,736,983 689,956,368	0.375000 2016/01/15	0.41
アメリカ	2.75 T-NOTE 231115	国債証券		6,300,000.00	10,521.23 10,501.1457	662,837,715 661,572,178	2.750000 2023/11/15	0.39
アメリカ	1.375 T-NOTE 200531	国債証券		6,500,000.00	9,998.94 9,933.8636	649,931,648 645,701,137	1.375000 2020/05/31	0.38
フランス	3.5 O.A.T 200425	国債証券		4,000,000.00	15,842.86 16,024.0730	633,714,640 640,962,920	3.500000 2020/04/25	0.38
フランス	3.75 O.A.T 210425	国債証券		3,900,000.00	16,176.34 16,430.5830	630,877,338 640,792,737	3.750000 2021/04/25	0.38
フランス	5.5 O.A.T 290425	国債証券		3,100,000.00	19,281.66 19,946.5500	597,731,615 618,343,050	5.500000 2029/04/25	0.36
アメリカ	2 T-NOTE 230215	国債証券		6,200,000.00	9,957.93 9,942.7023	617,392,094 616,447,545	2.000000 2023/02/15	0.36
イギリス	1.25 GILT 180722	国債証券		3,600,000.00	17,139.00 17,052.8700	617,004,000 613,903,320	1.250000 2018/07/22	0.36
フランス	3.25 O.A.T 211025	国債証券		3,800,000.00	15,740.89 16,026.1400	598,153,972 608,993,320	3.250000 2021/10/25	0.36
アメリカ	3.625 T-NOTE 210215	国債証券		5,400,000.00	11,337.60 11,245.6029	612,230,695 607,262,556	3.625000 2021/02/15	0.36

フランス	3.75 O.A.T 170425	国債証券		4,000,000.00	15,175.91 15,138.0190	607,036,560 605,520,760	3.750000 2017/04/25	0.36
フランス	4.25 O.A.T 231025	国債証券		3,500,000.00	16,890.14 17,280.8090	591,155,110 604,828,315	4.250000 2023/08/25	0.36
アメリカ	0.375 T-NOTE 160215	国債証券		5,700,000.00	10,305.89 10,291.0263	587,435,809 586,588,502	0.375000 2016/02/15	0.35
アメリカ	2.625 T-NOTE 200815	国債証券		5,500,000.00	10,720.50 10,638.5468	589,627,800 585,120,078	2.625000 2020/08/15	0.34
イタリア	6.5 ITALY GOVT 271101	国債証券		3,100,000.00	18,073.84 18,863.4420	560,289,288 584,766,702	6.500000 2027/11/01	0.34
フランス	5.75 O.A.T 321025	国債証券		2,700,000.00	20,380.69 21,197.0850	550,278,807 572,321,295	5.750000 2032/10/25	0.34
イタリア	6 ITALY GOVT 310501	国債証券		3,100,000.00	17,501.97 18,401.8120	542,561,318 570,456,172	6.000000 2031/05/01	0.34
アメリカ	2.125 T-NOTE 151231	国債証券		5,400,000.00	10,600.37 10,554.9812	572,420,512 569,968,987	2.125000 2015/12/31	0.34
フランス	2.5 O.A.T 201025	国債証券		3,700,000.00	15,053.45 15,290.9770	556,977,954 565,766,149	2.500000 2020/10/25	0.33
アメリカ	2.75 T-BOND 421115	国債証券		6,100,000.00	9,105.31 9,234.0015	555,423,940 563,274,095	2.750000 2042/11/15	0.33
フランス	3 O.A.T 220425	国債証券		3,500,000.00	15,476.31 15,787.0570	541,671,130 552,546,995	3.000000 2022/04/25	0.33
アメリカ	2.75 T-BOND 420815	国債証券		5,900,000.00	9,125.52 9,250.8753	538,406,089 545,801,647	2.750000 2042/08/15	0.32
フランス	4.25 O.A.T 190425	国債証券		3,300,000.00	16,179.78 16,252.8210	533,932,971 536,343,093	4.250000 2019/04/25	0.32
アメリカ	1.375 T-NOTE 151130	国債証券		5,100,000.00	10,470.13 10,438.8732	533,976,630 532,382,534	1.375000 2015/11/30	0.31
アメリカ	0.625 T-NOTE 170215	国債証券		5,200,000.00	10,267.72 10,227.5486	533,921,669 531,832,528	0.625000 2017/02/15	0.31
フランス	3 O.A.T 151025	国債証券		3,700,000.00	14,340.84 14,280.2140	530,611,302 528,367,918	3.000000 2015/10/25	0.31
イタリア	5.25 ITALY GOVT 291101	国債証券		3,100,000.00	16,222.50 16,975.5820	502,897,655 526,243,042	5.250000 2029/11/01	0.31

(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26年7月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	98.79
合計	98.79

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

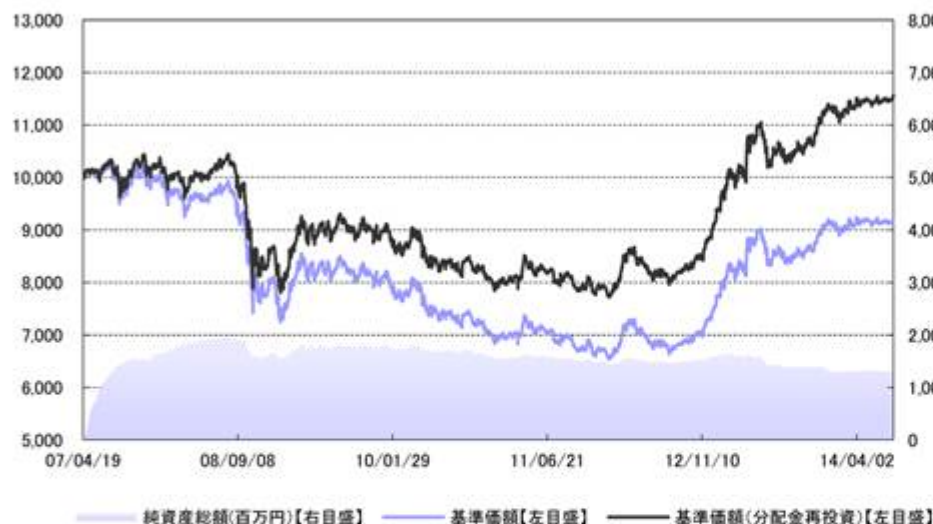
#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

[参考情報]

## 運用実績

### 1 基準価額・純資産の推移(設定日～2014年7月31日)



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

### 2 分配の推移

2014年 7月	16円
2014年 6月	16円
2014年 5月	16円
2014年 4月	16円
2014年 3月	16円
2014年 2月	16円
直近1年間累計	192円
設定来累計	1,875円

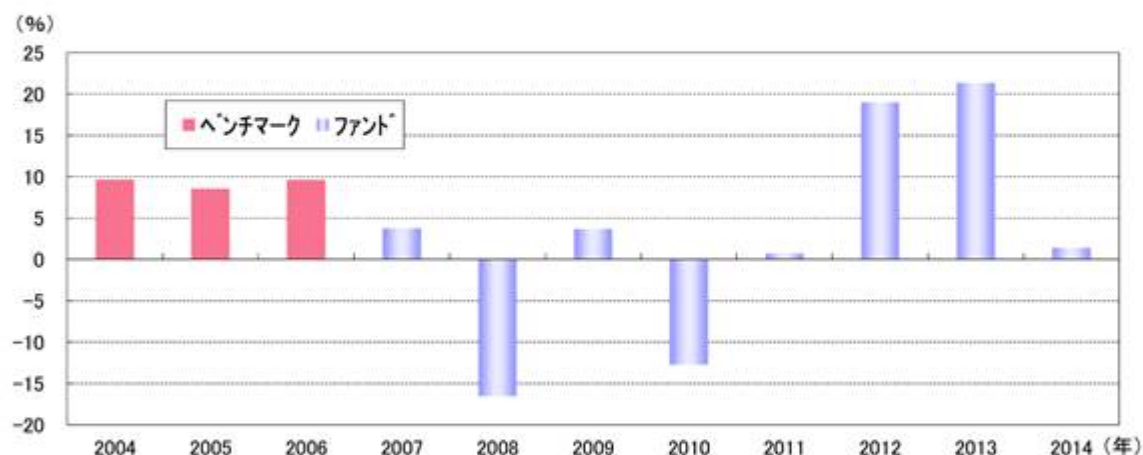
・分配金は1万口当たり、税引前

### 3 主要な資産の状況(2014年7月31日現在)

通貨別構成	比率	組入上位銘柄	種別	国・地域	比率
ユーロ	44.8%	1 1.75 T-NOTE 230515	国債	アメリカ	0.5%
アメリカドル	37.7%	2 2.625 T-NOTE 201115	国債	アメリカ	0.5%
イギリスポンド	8.2%	3 1.5 T-NOTE 180831	国債	アメリカ	0.4%
カナダドル	2.3%	4 0.375 T-NOTE 160115	国債	アメリカ	0.4%
オーストラリアドル	1.7%	5 2.75 T-NOTE 231115	国債	アメリカ	0.4%
メキシコペソ	1.1%	6 1.375 T-NOTE 200531	国債	アメリカ	0.4%
デンマーククローネ	0.8%	7 3.5 O.A.T 200425	国債	フランス	0.4%
ポーランドズロチ	0.7%	8 3.75 O.A.T 210425	国債	フランス	0.4%
その他	2.7%	9 5.5 O.A.T 290425	国債	フランス	0.4%
合計	100.0%	10 2 T-NOTE 230215	国債	アメリカ	0.4%

・各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

### 4 年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2007年は設定日から年末までの、2014年は7月31日までの収益率を表示
- ・2006年以前はベンチマークの年間収益率(委託会社の計算日基準)を表示

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



## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

申込みの受付	原則として、いつでも申込みができます。
申込単位	販売会社が定める単位
申込価額	申込受付日の翌営業日の基準価額
申込価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
申込単位・申込価額の照会方法	申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。 また、下記においてもご照会いただけます。 三菱UFJ投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。 ホームページアドレス <a href="http://www.am.mufg.jp/">http://www.am.mufg.jp/</a>
申込手数料	ありません。
申込方法	取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。 取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。 なお、申込みには分配金受取りコース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があり、分配金再投資コース（累積投資コース）を選択する場合には、取得申込者と販売会社との間で別に定める累積投資契約（販売会社によっては別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を使用する場合があります、この場合は当該別の名称に読み替えます。）を締結するものとします。申込みコースの取扱いには販売会社により異なる場合がありますので、販売会社にご確認ください。 取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。
申込受付時間	原則、午後3時までに受け付けた取得申込み（当該申込みの受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを）を当日の申込みとします。当該時刻を過ぎたの申込みは、翌営業日に受け付けたものとして取り扱います。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に取得申込みを締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。
その他	金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止すること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 <a href="http://www.am.mufg.jp/">http://www.am.mufg.jp/</a>
支払開始日	原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。

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

換金の詳細については販売会社にご確認ください。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

基準価額の 算出方法	<p>基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数</p> <p>なお、当ファンドでは1万口当たりの価額で表示されます。</p> <p>(注)「信託財産の純資産総額」とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。</p> <p>(主な評価方法)</p> <p>マザーファンド：計算日における基準価額で評価します。</p> <p>株式：原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場(外国で取引されているものについては、原則として、外国金融商品市場における計算時に知りうる直近の日の最終相場)で評価します。</p> <p>公社債等：原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)、第一種金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額で評価します。</p> <p>外貨建資産：原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円換算します。</p> <p>外国為替予約取引：原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。</p>
基準価額の 算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
基準価額の 照会方法	<p>基準価額は、販売会社にてご確認ください。</p> <p>また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。</p> <p>なお、下記においてもご照会いただけます。</p> <p>三菱UFJ投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) ホームページアドレス <a href="http://www.am.mufg.jp/">http://www.am.mufg.jp/</a></p>

#### (2)【保管】

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

## (3) 【信託期間】

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

## (4) 【計算期間】

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

## (5) 【その他】

ファンドの償還条件等	委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。（任意償還） ・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合 ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃されたときまたはやむを得ない事情が発生したとき このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。 委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。
信託約款の変更	委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。委託会社は、信託約款を変更しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。
ファンドの償還等に関する開示方法	委託会社は、ファンドの任意償還または信託約款の変更のうち重大な内容の変更を行おうとする場合、あらかじめその旨およびその内容を公告し、かつ、原則としてこれらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。この公告および書面には、原則として、受益者で異議のあるものは一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。
異議申立ておよび反対者の買取請求権	受益者は、委託会社がファンドの任意償還または信託約款について重大な内容の変更を行おうとする場合、原則として、一定の期間（1ヵ月以上）内に委託会社に対して異議を述べるすることができます。異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。なお、一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、ファンドの償還または信託約款の変更を行いません。その場合、償還しない旨または信託約款を変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、原則として、これらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。
関係法人との契約の更改	委託会社と販売会社との間で締結された「募集・販売の取扱い等に関する契約」の期間は、契約締結日から1ヵ年とし、期間満了3ヵ月前までに相手方に対し、何らの意思表示のないときは、同一の条件で契約を更新するものとし、その後も同様とします。
運用報告書	委託会社は、毎年1月および7月に終了する計算期間の末日および償還時に、運用報告書（平成26年12月以降は交付運用報告書）を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更等があった場合は、その内容を運用報告書に記載します。

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

## 信託約款（平成26年12月1日適用予定）の変更内容について

平成26年12月1日適用で下記の内容等の約款変更を行う予定です。下記の表は、この場合の信託約款の変更内容について記載しております。

（下線部\_\_\_\_\_は変更部分を、「 」は該当する条文を示します。）

変更前（旧）	変更後（新）
<新設>	<p>（運用報告書に記載すべき事項の提供）</p> <p>第 条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、当該運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。</p> <p>前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。</p>

## 4【受益者の権利等】

受益者の権利の主な内容は以下の通りです。

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 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、当特定期間(平成26年1月18日から平成26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26年1月17日現在]	当期 [平成26年7月17日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,829,559	1,658,996
親投資信託受益証券	1,300,263,764	1,299,301,422
未収入金	3,579,100	2,553,800
未収利息	4	2
流動資産合計	1,306,672,427	1,303,514,220
資産合計	1,306,672,427	1,303,514,220
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	2,280,398	2,276,147
未払解約金	3,032,028	858,658
未払受託者報酬	58,788	57,777
未払委託者報酬	823,013	808,871
その他未払費用	4,931	4,843
流動負債合計	6,199,158	4,006,296
負債合計	6,199,158	4,006,296
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sub>1</sub> 1,425,249,210	<sub>1</sub> 1,422,592,372
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	<sub>2</sub> 124,775,941	<sub>2</sub> 123,084,448
(分配準備積立金)	79,543,912	79,900,971
元本等合計	1,300,473,269	1,299,507,924
純資産合計	1,300,473,269	1,299,507,924
負債純資産合計	1,306,672,427	1,303,514,220

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	前期	当期
	自 平成25年 7月18日 至 平成26年 1月17日	自 平成26年 1月18日 至 平成26年 7月17日
<b>営業収益</b>		
受取利息	461	251
有価証券売買等損益	108,857,069	20,444,458
営業収益合計	108,857,530	20,444,709
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	363,577	345,336
委託者報酬	5,090,028	4,834,604
その他費用	30,483	28,948
営業費用合計	5,484,088	5,208,888
営業利益	103,373,442	15,235,821
経常利益	103,373,442	15,235,821
当期純利益	103,373,442	15,235,821
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	2,899,160	228,317
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	238,756,962	124,775,941
剰余金増加額又は欠損金減少額	40,553,721	9,963,442
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	40,553,721	9,963,442
剰余金減少額又は欠損金増加額	12,034,510	9,563,056
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	12,034,510	9,563,056
分配金	1 15,012,472	1 13,716,397
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	124,775,941	123,084,448



## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は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、基準価額で評価しております。
-------------------	---

## (貸借対照表に関する注記)

	前期 [ 平成26年1月17日現在 ]	当期 [ 平成26年7月17日現在 ]
1 期首元本額	1,655,670,102円	1,425,249,210円
期中追加設定元本額	102,024,597円	109,418,192円
期中一部解約元本額	332,445,489円	112,075,030円
2 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	124,775,941円	123,084,448円
3 受益権の総数	1,425,249,210口	1,422,592,372口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9125円 (9,125円)	0.9135円 (9,135円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期(自平成25年7月18日 至 平成26年1月17日)

## 1 分配金の計算過程

( 自 平成25年7月18日 至 平成25年8月19日 )		
費用控除後の配当等収益額	A	2,709,603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	15,447,992円
分配準備積立金額	D	70,307,315円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	88,464,910円
当ファンドの期末残存口数	F	1,632,732,188口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	541円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金額	I=F*H/10,000	2,612,371円

( 自 平成25年8月20日 至 平成25年9月17日 )		
費用控除後の配当等収益額	A	3,093,190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	15,945,364円
分配準備積立金額	D	69,683,933円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	88,722,487円
当ファンドの期末残存口数	F	1,628,339,565口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	544円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金額	I=F*H/10,000	2,605,343円

( 自 平成25年9月18日 至 平成25年10月17日 )		
費用控除後の配当等収益額	A	3,117,660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	16,230,737円
分配準備積立金額	D	68,815,199円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	88,163,596円
当ファンドの期末残存口数	F	1,607,932,210口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	548円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金額	I=F*H/10,000	2,572,691円

( 自 平成25年10月18日 至 平成25年11月18日 )		
費用控除後の配当等収益額	A	3,377,834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	16,571,296円
分配準備積立金額	D	67,780,160円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	87,729,290円
当ファンドの期末残存口数	F	1,584,422,203口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	553円
1万口当たり分配金額	H	16円

収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	2,535,075円
---------	----------------	------------

(自平成25年11月19日 至 平成25年12月17日)		
費用控除後の配当等収益額	A	3,085,647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	8,952,700円
収益調整金額	C	16,310,596円
分配準備積立金額	D	64,575,838円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	92,924,781円
当ファンドの期末残存口数	F	1,504,121,384口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	617円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	2,406,594円

(自平成25年12月18日 至 平成26年1月17日)		
費用控除後の配当等収益額	A	3,045,297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	10,377,951円
収益調整金額	C	17,404,507円
分配準備積立金額	D	68,401,062円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	99,228,817円
当ファンドの期末残存口数	F	1,425,249,210口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	696円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	2,280,398円

当期(自平成26年1月18日 至 平成26年7月17日)

1 分配金の計算過程

(自平成26年1月18日 至 平成26年2月17日)		
費用控除後の配当等収益額	A	2,267,132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	18,112,311円
分配準備積立金額	D	78,825,417円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	99,204,860円
当ファンドの期末残存口数	F	1,424,933,939口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	696円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	2,279,894円

(自平成26年2月18日 至 平成26年3月17日)		
費用控除後の配当等収益額	A	2,765,436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	18,955,787円
分配準備積立金額	D	78,302,162円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	100,023,385円
当ファンドの期末残存口数	F	1,429,742,025口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	699円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	2,287,587円

(自平成26年3月18日 至 平成26年4月17日)		
費用控除後の配当等収益額	A	3,053,071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	5,446,703円
収益調整金額	C	20,033,559円
分配準備積立金額	D	77,878,372円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	106,411,705円
当ファンドの期末残存口数	F	1,432,106,221口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	743円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	2,291,369円

( 自 平成26年4月18日 至 平成26年5月19日 )		
費用控除後の配当等収益額	A	2,381,165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	20,893,706円
分配準備積立金額	D	83,253,748円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	106,528,619円
当ファンドの期末残存口数	F	1,432,322,107口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	743円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	2,291,715円

( 自 平成26年5月20日 至 平成26年6月17日 )		
費用控除後の配当等収益額	A	2,102,068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	21,551,279円
分配準備積立金額	D	82,600,194円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	106,253,541円
当ファンドの期末残存口数	F	1,431,053,697口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	742円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	2,289,685円

( 自 平成26年6月18日 至 平成26年7月17日 )		
費用控除後の配当等収益額	A	2,401,474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	23,603,628円
分配準備積立金額	D	79,775,644円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	105,780,746円
当ファンドの期末残存口数	F	1,422,592,372口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	743円
1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	2,276,147円

## (金融商品に関する注記)

## 1 金融商品の状況に関する事項

区 分	前期 ( 自 平成25年 7月18日 至 平成26年 1月17日 )	当期 ( 自 平成26年 1月18日 至 平成26年 7月17日 )
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 親投資信託受益証券は、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、親投資信託受益証券に係るデリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同 左

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期	当期
	[ 平成26年1月17日現在 ]	[ 平成26年7月17日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>同 左</p> <p>同 左</p> <p>同 左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同 左

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	前期	当期
	[ 平成26年1月17日現在 ]	[ 平成26年7月17日現在 ]
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	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	14,513,317	4,246,082
合計	14,513,317	4,246,082

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	口数	評 価 額	備 考
親投資信託受益証券	三菱UFJ 外国債券マザーファンド	530,760,385	1,299,301,422	
	親投資信託受益証券 小計	530,760,385	1,299,301,422	
合計		530,760,385	1,299,301,422	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

&lt;参考&gt;

当ファンドは親投資信託受益証券を主要投資対象としております。

貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券の状況は以下の通りです。

「三菱UFJ」外国債券マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

	[ 平成26年1月17日現在 ]	[ 平成26年7月17日現在 ]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	254,595,177	207,114,564
コール・ローン	277,392,458	245,572,495
国債証券	193,999,769,664	168,504,879,523
派生商品評価勘定	1,325,914	519,958
未収入金	415,664,979	408,902,250
未収利息	2,046,482,953	1,617,055,709
前払費用	40,617,971	39,814,956
流動資産合計	197,035,849,116	171,023,859,455
資産合計	197,035,849,116	171,023,859,455
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,028	18,270
未払解約金	600,511,579	462,481,228
流動負債合計	600,515,607	462,499,498
負債合計	600,515,607	462,499,498
純資産の部		
元本等		
元本	81,509,949,811	69,672,450,248
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	114,925,383,698	100,888,909,709
元本等合計	196,435,333,509	170,561,359,957
純資産合計	196,435,333,509	170,561,359,957
負債純資産合計	197,035,849,116	171,023,859,455

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[ 平成26年1月17日現在 ]	[ 平成26年7月17日現在 ]
1 期首		
期首元本額	平成25年7月18日 96,843,281,765円	平成26年1月18日 81,509,949,811円
期首からの追加設定元本額	1,771,196,733円	1,466,775,374円
期首からの一部解約元本額	17,104,528,687円	13,304,274,937円
元本の内訳*		
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	127,815,936円	130,947,466円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	225,603,398円	234,275,739円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	145,595,280円	147,675,109円
三菱UFJ 外国債券オープン	1,979,429,724円	1,868,935,755円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	743,079,828円	778,183,822円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	1,996,665,324円	2,052,470,919円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	1,305,561,985円	1,319,579,916円
三菱UFJ 財産分散ファンド(毎月決算型)	1,142,021,685円	1,014,078,412円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	914,697,231円	817,280,070円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	112,519,689円	105,532,123円
FPバランスファンド(安定型)	66,616,673円	73,375,759円
FPバランスファンド(安定成長型)	81,264,554円	94,818,985円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	6,041,887円	12,429,457円
三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金)	1,929,691,600円	1,999,063,234円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型)	539,528,533円	530,760,385円

三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)	1,195,798,514円	1,251,890,694円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	67,029,765,272円	55,203,251,740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)	269,498円	267,280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)	1,634,299円	878,907円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2(適格機関投資家限定)	202,319,437円	158,508,566円
MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)	1,764,029,464円	1,878,245,910円
(合計)	81,509,949,811円	69,672,450,248円
2 受益権の総数	81,509,949,811口	69,672,450,248口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.4100円 (24,100円)	2.4480円 (24,480円)

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	(自平成25年7月18日 至平成26年1月17日)	(自平成26年1月18日 至平成26年7月17日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成26年1月17日現在]	[平成26年7月17日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引等関係に関する注記)に記載しております。 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[平成26年1月17日現在]	[平成26年7月17日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	5,337,078,982	924,390,390
合計	5,337,078,982	924,390,390

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## 通貨関連

区 分	種 類	[ 平成26年1月17日現在 ]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカドル	241,795,264		241,140,900	654,364
	カナダドル	13,382,720		13,370,000	12,720
	オーストラリアドル	5,546,100		5,524,800	21,300
	イギリスポンド	46,205,910		46,071,600	134,310
	スイスフラン	4,610,772		4,614,800	4,028
	シンガポールドル	4,936,740		4,927,200	9,540
	スウェーデンクローネ	4,041,150		4,040,000	1,150
	ノルウェークローネ	3,378,620		3,378,000	620
	デンマーククローネ	5,732,250		5,715,000	17,250
	メキシコペソ	5,540,500		5,502,000	38,500
	ポーランドズロチ	4,767,700		4,767,000	700
	南アフリカランド	5,263,610		5,263,500	110
	ユーロ	267,714,950		267,279,600	435,350
合 計		612,916,286		611,594,400	1,321,886

区 分	種 類	[ 平成26年7月17日現在 ]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカドル	219,651,246		219,564,000	87,246
	カナダドル	14,190,720		14,201,100	10,380
	オーストラリアドル	14,281,020		14,282,400	1,380
	イギリスポンド	50,543,210		50,527,900	15,310
	スイスフラン	3,406,197		3,395,700	10,497
	マレーシアリングギット	6,379,600		6,380,000	400
	ノルウェークローネ	3,275,700		3,278,000	2,300
	デンマーククローネ	5,552,910		5,532,000	20,910
	メキシコペソ	4,720,800		4,722,000	1,200
	ポーランドズロチ	6,645,400		6,644,000	1,400
	南アフリカランド	3,803,600		3,804,000	400
	ユーロ	263,026,485		262,644,100	382,385
	合 計		595,476,888		594,975,200

## (注) 時価の算定方法

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

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
アメリカドル				
国債証券	0.25 T-NOTE 150715	3,500,000.00	3,503,964.84	
	0.25 T-NOTE 150731	3,800,000.00	3,804,304.68	
	0.25 T-NOTE 150815	4,000,000.00	4,004,375.00	
	0.25 T-NOTE 150915	5,000,000.00	5,005,273.43	
	0.25 T-NOTE 150930	3,900,000.00	3,903,808.59	
	0.25 T-NOTE 151015	3,500,000.00	3,503,007.81	
	0.25 T-NOTE 151130	4,800,000.00	4,800,562.49	
	0.25 T-NOTE 151215	3,000,000.00	2,999,179.68	
	0.25 T-NOTE 160415	4,800,000.00	4,786,312.49	
	0.25 T-NOTE 160515	5,000,000.00	4,982,617.18	
	0.375 T-NOTE 151115	4,700,000.00	4,708,996.09	
	0.375 T-NOTE 160115	6,700,000.00	6,706,542.96	
	0.375 T-NOTE 160215	5,700,000.00	5,702,449.21	
	0.375 T-NOTE 160315	4,500,000.00	4,499,648.43	
	0.5 T-NOTE 160615	4,500,000.00	4,501,933.59	
	0.5 T-NOTE 170731	2,500,000.00	2,462,011.71	
	0.625 T-NOTE 160715	4,000,000.00	4,007,968.74	
	0.625 T-NOTE 160815	3,100,000.00	3,104,238.27	
	0.625 T-NOTE 161015	3,000,000.00	2,998,710.93	
	0.625 T-NOTE 161115	3,000,000.00	2,996,367.18	
	0.625 T-NOTE 170215	5,200,000.00	5,177,453.12	
	0.625 T-NOTE 170531	4,000,000.00	3,964,843.74	
	0.625 T-NOTE 170831	3,500,000.00	3,453,105.46	
	0.625 T-NOTE 170930	3,000,000.00	2,954,648.43	
	0.75 T-NOTE 170315	3,600,000.00	3,593,109.37	
	0.75 T-NOTE 170630	3,300,000.00	3,279,246.09	
	0.75 T-NOTE 171031	3,000,000.00	2,962,382.81	
	0.75 T-NOTE 171231	4,700,000.00	4,625,828.12	
	0.75 T-NOTE 180228	1,500,000.00	1,471,699.21	
	0.75 T-NOTE 180331	5,000,000.00	4,897,460.93	
	0.875 T-NOTE 160915	3,900,000.00	3,922,699.21	
	0.875 T-NOTE 161130	4,200,000.00	4,218,867.18	
	0.875 T-NOTE 161231	3,900,000.00	3,912,949.21	
	0.875 T-NOTE 170131	4,000,000.00	4,009,687.50	
	0.875 T-NOTE 170228	4,100,000.00	4,106,566.40	
	0.875 T-NOTE 170415	1,500,000.00	1,500,410.15	
	0.875 T-NOTE 170430	3,600,000.00	3,598,734.37	
	0.875 T-NOTE 170515	3,000,000.00	2,997,304.68	
	0.875 T-NOTE 170615	3,500,000.00	3,492,753.90	
	0.875 T-NOTE 180131	6,000,000.00	5,921,953.12	
	0.875 T-NOTE 190731	1,400,000.00	1,341,648.43	
	1 T-NOTE 160831	3,700,000.00	3,733,386.71	
	1 T-NOTE 160930	4,500,000.00	4,537,265.62	
	1 T-NOTE 161031	3,300,000.00	3,325,910.15	
	1 T-NOTE 170331	4,000,000.00	4,015,312.50	
	1 T-NOTE 190831	1,000,000.00	962,734.37	
	1 T-NOTE 190930	1,000,000.00	961,015.62	
	1.125 T-NOTE 190531	1,400,000.00	1,363,304.68	
	1.125 T-NOTE 191231	2,900,000.00	2,791,929.68	
	1.125 T-NOTE 200331	4,000,000.00	3,832,656.24	
	1.125 T-NOTE 200430	3,000,000.00	2,870,625.00	
	1.25 T-NOTE 150831	4,000,000.00	4,049,218.74	
	1.25 T-NOTE 150930	3,700,000.00	3,747,839.84	
	1.25 T-NOTE 151031	4,600,000.00	4,661,812.50	
	1.25 T-NOTE 181130	3,200,000.00	3,158,250.00	
	1.25 T-NOTE 190131	3,000,000.00	2,954,062.50	
	1.25 T-NOTE 190430	1,300,000.00	1,275,878.90	
	1.25 T-NOTE 191031	1,500,000.00	1,459,687.50	
	1.25 T-NOTE 200229	2,200,000.00	2,126,609.37	
	1.375 T-NOTE 151130	6,100,000.00	6,193,882.81	
	1.375 T-NOTE 180630	3,000,000.00	2,995,429.68	
	1.375 T-NOTE 180731	2,200,000.00	2,194,328.12	



1.375 T-NOTE 180930	4,000,000.00	3,979,375.00	
1.375 T-NOTE 181130	1,600,000.00	1,588,125.00	
1.375 T-NOTE 181231	2,200,000.00	2,181,179.68	
1.375 T-NOTE 190228	4,000,000.00	3,955,000.00	
1.375 T-NOTE 200131	2,700,000.00	2,631,550.77	
1.375 T-NOTE 200531	6,500,000.00	6,298,398.43	
1.5 T-NOTE 160630	4,200,000.00	4,281,046.87	
1.5 T-NOTE 160731	4,600,000.00	4,689,664.06	
1.5 T-NOTE 180831	7,300,000.00	7,307,984.37	
1.5 T-NOTE 181231	4,000,000.00	3,985,937.50	
1.5 T-NOTE 190131	4,000,000.00	3,980,937.50	
1.5 T-NOTE 190228	1,000,000.00	994,218.75	
1.5 T-NOTE 190331	1,400,000.00	1,391,523.43	
1.5 T-NOTE 190531	2,000,000.00	1,982,265.62	
1.625 T-NOTE 190331	4,000,000.00	3,995,312.50	
1.625 T-NOTE 190430	2,100,000.00	2,095,406.25	
1.625 T-NOTE 220815	2,300,000.00	2,179,968.75	
1.625 T-NOTE 221115	5,200,000.00	4,905,265.62	
1.75 T-NOTE 150731	3,700,000.00	3,761,714.84	
1.75 T-NOTE 160531	3,700,000.00	3,789,175.77	
1.75 T-NOTE 181031	1,600,000.00	1,614,875.00	
1.75 T-NOTE 201031	1,800,000.00	1,768,781.25	
1.75 T-NOTE 220515	2,700,000.00	2,592,843.75	
1.75 T-NOTE 230515	8,700,000.00	8,224,218.75	
1.875 T-NOTE 150630	4,700,000.00	4,778,761.71	
1.875 T-NOTE 170831	2,700,000.00	2,768,132.81	
1.875 T-NOTE 170930	2,700,000.00	2,765,390.62	
1.875 T-NOTE 171031	2,900,000.00	2,969,328.12	
2 T-NOTE 160131	4,000,000.00	4,103,281.24	
2 T-NOTE 160430	3,800,000.00	3,906,429.68	
2 T-NOTE 200731	3,100,000.00	3,107,507.81	
2 T-NOTE 201130	3,500,000.00	3,487,148.43	
2 T-NOTE 210228	800,000.00	794,437.50	
2 T-NOTE 210531	2,000,000.00	1,979,140.62	
2 T-NOTE 211115	3,600,000.00	3,545,718.75	
2 T-NOTE 220215	3,200,000.00	3,143,000.00	
2 T-NOTE 230215	7,700,000.00	7,459,976.56	
2.125 T-NOTE 151231	5,400,000.00	5,543,437.50	
2.125 T-NOTE 160229	2,600,000.00	2,674,445.31	
2.125 T-NOTE 200831	4,000,000.00	4,029,375.00	
2.125 T-NOTE 210815	3,900,000.00	3,885,375.00	
2.25 T-NOTE 160331	3,700,000.00	3,816,636.71	
2.25 T-NOTE 171130	2,900,000.00	3,002,292.96	
2.25 T-NOTE 180731	1,500,000.00	1,547,871.09	
2.25 T-NOTE 210331	2,600,000.00	2,620,312.50	
2.25 T-NOTE 210430	4,000,000.00	4,026,875.00	
2.375 T-NOTE 160331	1,900,000.00	1,964,644.53	
2.375 T-NOTE 170731	2,100,000.00	2,185,722.65	
2.375 T-NOTE 180531	2,000,000.00	2,075,078.12	
2.375 T-NOTE 180630	900,000.00	933,433.59	
2.375 T-NOTE 201231	3,500,000.00	3,564,804.68	
2.5 T-NOTE 170630	1,800,000.00	1,880,437.50	
2.5 T-NOTE 230815	2,700,000.00	2,711,179.68	
2.5 T-NOTE 240515	3,000,000.00	2,989,921.87	
2.625 T-NOTE 160229	2,200,000.00	2,280,867.18	
2.625 T-NOTE 160430	2,100,000.00	2,182,687.50	
2.625 T-NOTE 180131	1,800,000.00	1,885,781.25	
2.625 T-NOTE 180430	1,700,000.00	1,781,148.43	
2.625 T-NOTE 200815	5,500,000.00	5,706,250.00	
2.625 T-NOTE 201115	7,400,000.00	7,664,203.12	
2.75 T-BOND 420815	5,900,000.00	5,267,132.81	
2.75 T-BOND 421115	6,100,000.00	5,436,148.43	
2.75 T-NOTE 161130	2,600,000.00	2,728,273.43	
2.75 T-NOTE 170531	1,700,000.00	1,787,722.65	
2.75 T-NOTE 171231	2,000,000.00	2,104,062.50	
2.75 T-NOTE 180228	2,200,000.00	2,314,468.75	
2.75 T-NOTE 190215	2,700,000.00	2,836,898.43	

2.75 T-NOTE 231115	6,300,000.00	6,444,210.93
2.75 T-NOTE 240215	5,000,000.00	5,103,906.25
2.875 T-BOND 430515	4,800,000.00	4,378,500.00
2.875 T-NOTE 180331	2,800,000.00	2,958,375.00
3 T-BOND 420515	3,600,000.00	3,388,218.75
3 T-NOTE 160831	3,000,000.00	3,154,101.56
3 T-NOTE 160930	3,300,000.00	3,474,152.34
3 T-NOTE 170228	1,800,000.00	1,902,867.18
3.125 T-BOND 411115	3,100,000.00	2,998,523.43
3.125 T-BOND 420215	5,100,000.00	4,924,687.50
3.125 T-BOND 430215	4,400,000.00	4,227,093.75
3.125 T-NOTE 161031	3,400,000.00	3,592,976.56
3.125 T-NOTE 170131	3,200,000.00	3,391,124.99
3.125 T-NOTE 170430	1,900,000.00	2,017,414.06
3.125 T-NOTE 190515	4,000,000.00	4,271,406.24
3.125 T-NOTE 210515	2,900,000.00	3,086,007.81
3.25 T-NOTE 160531	1,900,000.00	1,999,601.56
3.25 T-NOTE 160630	2,400,000.00	2,529,281.24
3.25 T-NOTE 160731	3,000,000.00	3,165,820.31
3.25 T-NOTE 161231	2,700,000.00	2,866,746.09
3.25 T-NOTE 170331	2,200,000.00	2,341,539.06
3.375 T-BOND 440515	1,600,000.00	1,608,124.99
3.375 T-NOTE 191115	3,600,000.00	3,897,140.62
3.5 T-BOND 390215	1,400,000.00	1,457,640.62
3.5 T-NOTE 180215	4,300,000.00	4,636,105.46
3.5 T-NOTE 200515	4,100,000.00	4,463,234.37
3.625 T-NOTE 190815	3,000,000.00	3,279,843.75
3.625 T-NOTE 200215	4,200,000.00	4,605,234.37
3.625 T-NOTE 210215	5,400,000.00	5,923,968.75
3.75 T-BOND 410815	2,300,000.00	2,493,343.75
3.75 T-NOTE 181115	3,900,000.00	4,267,910.15
3.875 T-BOND 400815	1,900,000.00	2,104,250.00
3.875 T-NOTE 180515	2,200,000.00	2,408,054.68
4 T-NOTE 180815	2,300,000.00	2,536,468.75
4.25 T-BOND 390515	1,200,000.00	1,406,718.75
4.25 T-BOND 401115	2,100,000.00	2,468,156.25
4.25 T-NOTE 150815	3,600,000.00	3,758,906.25
4.25 T-NOTE 171115	1,800,000.00	1,982,039.06
4.375 T-BOND 380215	800,000.00	953,812.50
4.375 T-BOND 391115	1,800,000.00	2,152,828.12
4.375 T-BOND 400515	1,900,000.00	2,274,656.25
4.375 T-BOND 410515	2,000,000.00	2,399,687.50
4.5 T-BOND 360215	1,400,000.00	1,697,500.00
4.5 T-BOND 380515	700,000.00	849,187.50
4.5 T-BOND 390815	1,900,000.00	2,312,359.37
4.5 T-NOTE 151115	3,700,000.00	3,908,992.18
4.5 T-NOTE 160215	1,900,000.00	2,024,761.71
4.5 T-NOTE 170515	1,500,000.00	1,650,996.09
4.625 T-BOND 400215	2,400,000.00	2,979,750.00
4.625 T-NOTE 161115	2,300,000.00	2,510,863.28
4.625 T-NOTE 170215	2,100,000.00	2,306,718.75
4.75 T-BOND 410215	2,200,000.00	2,791,593.75
4.75 T-NOTE 170815	1,800,000.00	2,003,765.62
4.875 T-NOTE 160815	1,700,000.00	1,852,136.71
5 T-BOND 370515	800,000.00	1,036,750.00
5.125 T-NOTE 160515	2,500,000.00	2,714,941.40
5.25 T-BOND 281115	900,000.00	1,150,664.06
5.25 T-BOND 290215	600,000.00	767,625.00
5.375 T-BOND 310215	1,400,000.00	1,834,984.37
5.5 T-BOND 280815	700,000.00	913,937.50
6 T-BOND 260215	900,000.00	1,200,375.00
6.125 T-BOND 271115	1,100,000.00	1,507,429.68
6.25 T-BOND 230815	1,100,000.00	1,446,929.68
6.25 T-BOND 300515	900,000.00	1,276,453.12
6.5 T-BOND 261115	500,000.00	698,750.00
7.25 T-BOND 160515	700,000.00	786,707.03
7.5 T-BOND 161115	1,500,000.00	1,736,894.53

	8 T-BOND 211115	900,000.00	1,255,535.15	
	8.125 T-BOND 190815	500,000.00	656,953.12	
	8.75 T-BOND 170515	900,000.00	1,097,964.84	
	8.75 T-BOND 200815	700,000.00	974,476.56	
	8.875 T-BOND 190215	600,000.00	795,328.12	
	国債証券 小計	611,900,000.00	626,043,280.41 (63,643,559,886)	
	アメリカドル 小計	611,900,000.00	626,043,280.41 (63,643,559,886)	
	カナダドル			
国債証券	1 CAN GOVT 151101	700,000.00	699,776.00	
	1 CAN GOVT 160801	1,100,000.00	1,098,097.00	
	1.25 CAN GOVT 160201	900,000.00	902,736.00	
	1.25 CAN GOVT 180301	1,200,000.00	1,196,988.00	
	1.25 CAN GOVT 180901	1,000,000.00	992,750.00	
	1.5 CAN GOVT 150801	1,500,000.00	1,507,560.00	
	1.5 CAN GOVT 170201	400,000.00	403,688.00	
	1.5 CAN GOVT 170301	1,400,000.00	1,413,650.00	
	1.5 CAN GOVT 170901	1,100,000.00	1,108,305.00	
	1.5 CAN GOVT 230601	1,500,000.00	1,429,995.00	
	1.75 CAN GOVT 190301	800,000.00	808,720.00	
	1.75 CAN GOVT 190901	800,000.00	805,912.00	
	2 CAN GOVT 160601	1,700,000.00	1,728,849.00	
	2.5 CAN GOVT 240601	1,500,000.00	1,540,275.00	
	2.75 CAN GOVT 160901	1,700,000.00	1,759,228.00	
	2.75 CAN GOVT 220601	1,400,000.00	1,480,836.00	
	3 CAN GOVT 151201	2,000,000.00	2,053,620.00	
	3.25 CAN GOVT 210601	1,200,000.00	1,312,524.00	
	3.5 CAN GOVT 200601	1,400,000.00	1,543,696.00	
	3.5 CAN GOVT 451201	1,700,000.00	1,966,900.00	
	3.75 CAN GOVT 190601	2,100,000.00	2,318,505.00	
	4 CAN GOVT 160601	1,300,000.00	1,370,096.00	
	4 CAN GOVT 170601	1,100,000.00	1,188,363.00	
	4 CAN GOVT 410601	1,700,000.00	2,096,525.00	
	4.25 CAN GOVT 180601	1,500,000.00	1,662,855.00	
	5 CAN GOVT 370601	1,500,000.00	2,080,245.00	
	5.75 CAN GOVT 290601	1,200,000.00	1,684,116.00	
	5.75 CAN GOVT 330601	1,300,000.00	1,897,922.00	
	8 CAN GOVT 270601	400,000.00	649,988.00	
	国債証券 小計	37,100,000.00	40,702,720.00 (3,854,140,556)	
	カナダドル 小計	37,100,000.00	40,702,720.00 (3,854,140,556)	
	オーストラリアドル			
国債証券	2.75 AUST GOVT 240421	1,500,000.00	1,416,255.00	
	3.25 AUST GOVT 181021	400,000.00	407,396.00	
	3.25 AUST GOVT 250421	1,100,000.00	1,074,480.00	
	3.25 AUST GOVT 290421	1,000,000.00	939,260.00	
	4.25 AUST GOVT 170721	1,900,000.00	1,991,485.00	
	4.25 AUST GOVT 260421	900,000.00	958,761.00	
	4.5 AUST GOVT 200415	2,300,000.00	2,482,873.00	
	4.5 AUST GOVT 330421	700,000.00	752,647.00	
	4.75 AUST GOVT 151021	1,500,000.00	1,541,775.00	
	4.75 AUST GOVT 160615	2,300,000.00	2,396,853.00	
	4.75 AUST GOVT 270421	1,300,000.00	1,447,225.00	
	5.25 AUST GOVT 190315	2,100,000.00	2,320,374.00	
	5.5 AUST GOVT 180121	2,200,000.00	2,407,834.00	
	5.5 AUST GOVT 230421	2,300,000.00	2,674,854.00	
	5.75 AUST GOVT 210515	2,200,000.00	2,552,770.00	
	5.75 AUST GOVT 220715	1,900,000.00	2,230,049.00	
	6 AUST GOVT 170215	2,300,000.00	2,498,444.00	
	国債証券 小計	27,900,000.00	30,093,335.00 (2,866,089,225)	
	オーストラリアドル 小計	27,900,000.00	30,093,335.00 (2,866,089,225)	
	イギリスポンド			
国債証券	1 GILT 170907	3,100,000.00	3,051,175.00	
	1.25 GILT 180722	3,600,000.00	3,523,320.00	

1.75 GILT 170122	1,800,000.00	1,822,050.00	
1.75 GILT 190722	1,800,000.00	1,775,430.00	
1.75 GILT 220907	2,700,000.00	2,544,885.00	
2 GILT 160122	2,300,000.00	2,339,100.00	
2.25 GILT 230907	2,900,000.00	2,806,040.00	
2.75 GILT 240907	1,100,000.00	1,097,800.00	
3.25 GILT 440122	2,600,000.00	2,533,830.00	
3.5 GILT 450122	400,000.00	407,900.00	
3.5 GILT 680722	1,000,000.00	1,039,350.00	
3.75 GILT 190907	2,000,000.00	2,168,600.00	
3.75 GILT 200907	2,400,000.00	2,612,160.00	
3.75 GILT 210907	2,100,000.00	2,292,570.00	
3.75 GILT 520722	1,500,000.00	1,624,725.00	
4 GILT 160907	2,500,000.00	2,656,125.00	
4 GILT 220307	1,400,000.00	1,554,630.00	
4 GILT 600122	1,300,000.00	1,506,375.00	
4.25 GILT 271207	1,400,000.00	1,596,630.00	
4.25 GILT 320607	2,300,000.00	2,632,005.00	
4.25 GILT 360307	2,100,000.00	2,409,120.00	
4.25 GILT 390907	1,400,000.00	1,617,280.00	
4.25 GILT 401207	1,800,000.00	2,084,490.00	
4.25 GILT 461207	1,700,000.00	1,995,630.00	
4.25 GILT 491207	1,500,000.00	1,779,075.00	
4.25 GILT 551207	1,700,000.00	2,053,260.00	
4.5 GILT 190307	2,200,000.00	2,453,220.00	
4.5 GILT 340907	2,100,000.00	2,482,935.00	
4.5 GILT 421207	2,100,000.00	2,541,105.00	
4.75 GILT 150907	2,500,000.00	2,614,375.00	
4.75 GILT 200307	2,300,000.00	2,620,965.00	
4.75 GILT 301207	1,700,000.00	2,052,835.00	
4.75 GILT 381207	1,800,000.00	2,232,900.00	
5 GILT 180307	1,900,000.00	2,124,960.00	
5 GILT 250307	1,800,000.00	2,169,990.00	
6 GILT 281207	1,000,000.00	1,349,100.00	
8 GILT 151207	600,000.00	660,540.00	
8 GILT 210607	1,300,000.00	1,770,795.00	
8.75 GILT 170825	500,000.00	610,175.00	
国債証券 小計	72,200,000.00	79,207,450.00 (13,801,898,162)	
イギリスポンド 小計	72,200,000.00	79,207,450.00 (13,801,898,162)	
スイスフラン			
国債証券			
2 SWISS GOVT 210428	200,000.00	222,840.00	
2.25 SWISS GOVT 200706	400,000.00	447,760.00	
2.5 SWISS GOVT 160312	750,000.00	780,525.00	
3 SWISS GOVT 180108	700,000.00	771,890.00	
3 SWISS GOVT 190512	560,000.00	637,336.00	
4 SWISS GOVT 230211	400,000.00	518,640.00	
4 SWISS GOVT 280408	800,000.00	1,106,720.00	
4.25 SWISS GOVT 170605	700,000.00	785,260.00	
国債証券 小計	4,510,000.00	5,270,971.00 (596,621,207)	
スイスフラン 小計	4,510,000.00	5,270,971.00 (596,621,207)	
シンガポールドル			
国債証券			
0.5 SINGAPORGOVT 180401	300,000.00	297,000.00	
1.125SINGAPORGOVT 160401	500,000.00	506,150.00	
2.25 SINGAPORGOVT 210601	500,000.00	510,650.00	
2.375 SINGAPORGOV 170401	600,000.00	631,380.00	
2.5 SINGAPORGOVT 190601	400,000.00	425,600.00	
2.75 SINGAPORGOVT 230701	200,000.00	207,360.00	
2.75 SINGAPORGOVT 420401	500,000.00	468,250.00	
2.875SINGAPORGOVT 150701	900,000.00	921,420.00	
2.875SINGAPORGOVT 300901	300,000.00	297,600.00	
3 SINGAPORGOVT 240901	400,000.00	418,520.00	
3.125SINGAPORGOVT 220901	500,000.00	536,650.00	
3.25 SINGAPORGOVT 200901	500,000.00	545,750.00	
3.375 SINGAPORGOV 330901	300,000.00	316,950.00	

	3.5 SINGAPORGVOT 270301	500,000.00	540,000.00	
	3.75 SINGAPORGVOT 160901	700,000.00	749,700.00	
	4 SINGAPORGVOT 180901	400,000.00	450,720.00	
	国債証券 小計	7,500,000.00	7,823,700.00 (640,526,319)	
	シンガポールドル 小計	7,500,000.00	7,823,700.00 (640,526,319)	
	マレーシアリングギット			
国債証券	3.172 MALAYSIA 160715	1,100,000.00	1,095,193.00	
	3.197 MALAYSIAGOV 151015	200,000.00	199,662.00	
	3.26 MALAYSIAGOV 180301	1,100,000.00	1,087,339.00	
	3.314 MALAYSIA 171031	1,100,000.00	1,091,519.00	
	3.418MALAYSIAGOV 220815	400,000.00	386,004.00	
	3.48 MALAYSIAGOV 230315	1,500,000.00	1,449,435.00	
	3.492 MALAYSIAGOV 200331	400,000.00	394,196.00	
	3.502MALAYSIAGOV 270531	1,400,000.00	1,303,386.00	
	3.58 MALAYSIAGOV 180928	1,200,000.00	1,198,584.00	
	3.654 MALAYSIAGOV 191031	300,000.00	299,607.00	
	3.814MALAYSIAGOV 170215	1,400,000.00	1,409,548.00	
	3.835MALAYSIAGOV 150812	1,800,000.00	1,810,116.00	
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	300,000.00	280,158.00	
	3.889 MALAYSIAGO 200731	1,900,000.00	1,907,961.00	
	3.892 MALAYSIAGOV 270315	1,200,000.00	1,164,624.00	
	4.012 MALAYSIAGOV 170915	1,900,000.00	1,925,042.00	
	4.048 MALAYSIA 210930	1,200,000.00	1,216,416.00	
	4.127 MALAYSIA 320415	1,000,000.00	969,100.00	
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	1,000,000.00	1,018,600.00	
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	400,000.00	407,384.00	
	4.24 MALAYSIAGOV 180207	1,000,000.00	1,021,690.00	
	4.262MALAYSIAGOV 160915	2,900,000.00	2,950,286.00	
	4.378MALAYSIAGOV 191129	2,000,000.00	2,061,440.00	
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	1,500,000.00	1,535,850.00	
	5.734MALAYSIAGOV 190730	700,000.00	764,113.00	
	国債証券 小計	28,900,000.00	28,947,253.00 (923,417,370)	
	マレーシアリングギット 小計	28,900,000.00	28,947,253.00 (923,417,370)	
	スウェーデンクローネ			
国債証券	1.5 SWD GOVT 231113	7,600,000.00	7,544,292.00	
	2.5 SWD GOVT 250512	3,800,000.00	4,090,358.00	
	3 SWD GOVT 160712	5,900,000.00	6,213,349.00	
	3.5 SWD GOVT 220601	6,400,000.00	7,409,216.00	
	3.5 SWD GOVT 390330	5,000,000.00	6,081,200.00	
	3.75 SWD GOVT 170812	6,700,000.00	7,360,285.00	
	4.25 SWD GOVT 190312	10,000,000.00	11,565,000.00	
	4.5 SWD GOVT 150812	8,000,000.00	8,365,840.00	
	5 SWD GOVT 201201	5,100,000.00	6,306,660.00	
	国債証券 小計	58,500,000.00	64,936,200.00 (966,900,018)	
	スウェーデンクローネ 小計	58,500,000.00	64,936,200.00 (966,900,018)	
	ノルウェークローネ			
国債証券	2 NORWE GOVT 230524	5,100,000.00	4,989,585.00	
	3 NORWE GOVT 240314	3,200,000.00	3,360,960.00	
	3.75 NORWE GOVT 210525	6,500,000.00	7,204,600.00	
	4.25 NORWE GOVT 170519	6,800,000.00	7,324,280.00	
	4.5 NORWE GOVT 190522	6,300,000.00	7,103,880.00	
	国債証券 小計	27,900,000.00	29,983,305.00 (491,726,202)	
	ノルウェークローネ 小計	27,900,000.00	29,983,305.00 (491,726,202)	
	デンマーククローネ			
国債証券	1.5 DMK GOVT 231115	7,300,000.00	7,467,535.00	
	2.5 DMK GOVT 161115	3,300,000.00	3,483,645.00	
	3 DMK GOVT 211115	9,500,000.00	10,949,700.00	
	4 DMK GOVT 151115	10,900,000.00	11,468,980.00	
	4 DMK GOVT 171115	5,400,000.00	6,083,640.00	
	4 DMK GOVT 191115	10,000,000.00	11,848,500.00	

	4.5 DMK GOVT 391115	12,900,000.00	18,773,370.00	
	7 DMK GOVT 241110	2,700,000.00	4,199,850.00	
	国債証券 小計	62,000,000.00	74,275,220.00 (1,369,635,056)	
	デンマーククローネ 小計	62,000,000.00	74,275,220.00 (1,369,635,056)	
	メキシコペソ			
国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	13,600,000.00	18,160,896.00	
	10 MEXICAN BONOS 361120	7,000,000.00	9,765,980.00	
	4.75 MEXICAN BONO 180614	14,600,000.00	14,777,244.00	
	5 MEXICAN BONOS 170615	14,000,000.00	14,486,920.00	
	6.25 MEXICAN BONO 160616	15,000,000.00	15,837,450.00	
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	11,700,000.00	12,550,122.00	
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	10,700,000.00	11,397,426.00	
	7.25 MEXICAN BONO 161215	14,000,000.00	15,193,360.00	
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	9,500,000.00	10,759,985.00	
	7.75 MEXICAN BONO 171214	14,900,000.00	16,660,137.00	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	14,900,000.00	17,003,135.00	
	7.75 MEXICAN BONO 341123	1,700,000.00	1,939,037.00	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	10,200,000.00	11,542,626.00	
	8 MEXICAN BONOS 151217	11,000,000.00	11,756,360.00	
	8 MEXICAN BONOS 200611	9,300,000.00	10,728,108.00	
	8 MEXICAN BONOS 231207	9,900,000.00	11,575,080.00	
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	5,800,000.00	6,723,476.00	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	10,200,000.00	12,434,514.00	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	10,700,000.00	13,054,535.00	
	国債証券 小計	208,700,000.00	236,346,391.00 (1,862,409,561)	
	メキシコペソ 小計	208,700,000.00	236,346,391.00 (1,862,409,561)	
	ポーランドズロチ			
国債証券	2.5 POLAND 180725	2,800,000.00	2,765,980.00	
	3.25 POLAND 190725	600,000.00	608,070.00	
	3.75 POLAND 180425	1,900,000.00	1,965,550.00	
	4 POLAND 231025	2,900,000.00	3,033,110.00	
	4.75 POLAND 161025	2,100,000.00	2,202,375.00	
	4.75 POLAND 170425	2,100,000.00	2,219,490.00	
	5 POLAND 160425	3,000,000.00	3,129,150.00	
	5.25 POLAND 171025	2,400,000.00	2,590,440.00	
	5.25 POLAND 201025	2,000,000.00	2,241,100.00	
	5.5 POLAND 191025	2,000,000.00	2,241,800.00	
	5.75 POLAND 211025	1,700,000.00	1,972,850.00	
	5.75 POLAND 220923	2,500,000.00	2,925,125.00	
	5.75 POLAND 290425	900,000.00	1,103,544.00	
	6.25 POLAND 151024	3,000,000.00	3,141,450.00	
	POLAND 150725	900,000.00	878,670.00	
	POLAND 160125	2,200,000.00	2,120,360.00	
	POLAND 160725	600,000.00	570,900.00	
	国債証券 小計	33,600,000.00	35,709,964.00 (1,186,999,203)	
	ポーランドズロチ 小計	33,600,000.00	35,709,964.00 (1,186,999,203)	
	南アフリカランド			
国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	15,200,000.00	17,904,536.00	
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	9,100,000.00	6,870,045.00	
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	8,100,000.00	6,145,308.00	
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	9,300,000.00	8,795,475.00	
	7 SOUTH AFRICA 310228	9,000,000.00	7,716,150.00	
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	9,200,000.00	9,041,024.00	
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	5,700,000.00	5,610,510.00	
	8 SOUTH AFRICA 181221	8,400,000.00	8,583,960.00	
	8 SOUTH AFRICA 300131	1,500,000.00	1,421,265.00	
	8.25 SOUTH AFRICA 170915	8,800,000.00	9,073,944.00	
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	2,700,000.00	2,601,558.00	
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	5,300,000.00	5,187,481.00	
	国債証券 小計	92,300,000.00	88,951,256.00 (846,815,957)	

南アフリカランド 小計		92,300,000.00	88,951,256.00 (846,815,957)	
ユーロ				
国債証券	0 NETH GOVT 160415	1,100,000.00	1,099,175.00	
	0 SCHATS 151211	800,000.00	799,880.00	
	0.25 O.A.T 151125	1,900,000.00	1,905,415.00	
	0.25 O.A.T 161125	700,000.00	702,555.00	
	0.25 OBL 180413	1,600,000.00	1,606,000.00	
	0.25 SCHATS 150911	800,000.00	802,160.00	
	0.25 SCHATS 160311	500,000.00	501,900.00	
	0.5 NETH GOVT 170415	500,000.00	505,500.00	
	0.5 OBL 170407	2,300,000.00	2,328,405.00	
	0.5 OBL 171013	1,800,000.00	1,824,930.00	
	0.5 OBL 180223	1,600,000.00	1,621,600.00	
	0.5 OBL 190412	900,000.00	908,100.00	
	0.75 OBL 170224	2,100,000.00	2,139,480.00	
	1 BTAN 170725	2,200,000.00	2,255,660.00	
	1 O.A.T 180525	2,500,000.00	2,568,875.00	
	1 O.A.T 181125	2,400,000.00	2,466,960.00	
	1 O.A.T 190525	1,700,000.00	1,744,285.00	
	1 OBL 181012	1,000,000.00	1,032,950.00	
	1 OBL 190222	1,600,000.00	1,652,800.00	
	1.125 FINNISH GOV 180915	400,000.00	414,040.00	
	1.25 BEL GOVT 180622	1,000,000.00	1,036,550.00	
	1.25 NETH GOVT 180115	1,700,000.00	1,762,900.00	
	1.25 NETH GOVT 190115	700,000.00	727,930.00	
	1.25 OBL 161014	1,700,000.00	1,746,580.00	
	1.5 BUND 220904	2,100,000.00	2,200,170.00	
	1.5 BUND 230215	2,200,000.00	2,294,710.00	
	1.5 BUND 230515	2,000,000.00	2,080,800.00	
	1.5 BUND 240515	700,000.00	719,915.00	
	1.5 FINNISH GOVT 230415	600,000.00	614,790.00	
	1.5 ITALY GOVT 161215	500,000.00	509,000.00	
	1.625 FINNISH GOV 220915	400,000.00	416,240.00	
	1.65 AUSTRIA GOVT 241021	300,000.00	305,550.00	
	1.75 AUSTRIA GOVT 231020	300,000.00	312,345.00	
	1.75 BTAN 170225	2,300,000.00	2,398,900.00	
	1.75 BUND 220704	2,800,000.00	2,993,200.00	
	1.75 BUND 240215	1,600,000.00	1,687,760.00	
	1.75 FINNISH GOVT 160415	700,000.00	720,755.00	
	1.75 NETH GOVT 230715	1,800,000.00	1,877,220.00	
	1.75 O.A.T 230525	2,900,000.00	3,006,575.00	
	1.75 O.A.T 241125	500,000.00	506,375.00	
	1.75 OBL 151009	2,000,000.00	2,042,500.00	
	1.875 FINNISH GOV 170415	700,000.00	733,950.00	
	1.95 AUSTRIA GOVT 190618	400,000.00	429,600.00	
	2 BTAN 150712	3,100,000.00	3,159,675.00	
	2 BUND 220104	2,400,000.00	2,616,240.00	
	2 BUND 230815	1,800,000.00	1,946,430.00	
	2 FINNISH GOVT 240415	600,000.00	635,040.00	
	2 NETH GOVT 240715	900,000.00	949,815.00	
	2 OBL 160226	1,600,000.00	1,650,880.00	
	2.1 SPAIN GOVT 170430	1,800,000.00	1,866,510.00	
	2.25 BEL GOVT 230622	1,300,000.00	1,391,000.00	
	2.25 BTAN 160225	3,100,000.00	3,209,430.00	
	2.25 BUND 200904	1,700,000.00	1,879,435.00	
	2.25 BUND 210904	1,500,000.00	1,663,125.00	
	2.25 ITALY GOVT 160515	2,500,000.00	2,577,750.00	
	2.25 NETH GOVT 220715	1,800,000.00	1,964,610.00	
	2.25 O.A.T 221025	2,600,000.00	2,814,110.00	
	2.25 O.A.T 240525	2,900,000.00	3,095,460.00	
	2.4 AUSTRIA GOVT 340523	200,000.00	210,230.00	
	2.5 BTAN 160725	3,000,000.00	3,146,250.00	
	2.5 BUND 210104	2,100,000.00	2,357,775.00	
	2.5 BUND 440704	1,900,000.00	2,067,105.00	
	2.5 BUND 460815	200,000.00	217,530.00	
	2.5 ITALY GOVT 190501	1,800,000.00	1,896,930.00	

2.5 NETH GOVT 170115	1,900,000.00	2,014,855.00	
2.5 NETH GOVT 330115	1,100,000.00	1,180,850.00	
2.5 O.A.T 201025	3,700,000.00	4,098,675.00	
2.5 O.A.T 300525	800,000.00	829,040.00	
2.6 BEL GOVT 240622	900,000.00	980,550.00	
2.625 FINNISH GOV 420704	400,000.00	439,480.00	
2.75 BEL GOVT 160328	1,000,000.00	1,045,450.00	
2.75 FINNISH GOVT 280704	500,000.00	558,425.00	
2.75 ITALY GOVT 161115	1,700,000.00	1,779,645.00	
2.75 NETH GOVT 470115	400,000.00	451,000.00	
2.75 O.A.T 271025	2,700,000.00	2,943,000.00	
2.75 OBL 160408	2,800,000.00	2,931,180.00	
2.75 SPAIN GOVT 190430	900,000.00	962,505.00	
2.75 SPAIN GOVT 241031	900,000.00	898,515.00	
3 BEL GOVT 190928	1,100,000.00	1,236,510.00	
3 BEL GOVT 340622	300,000.00	325,560.00	
3 BUND 200704	2,100,000.00	2,412,900.00	
3 ITALY GOVT 151101	2,900,000.00	2,994,540.00	
3 O.A.T 151025	3,700,000.00	3,838,565.00	
3 O.A.T 220425	3,700,000.00	4,226,510.00	
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	600,000.00	716,010.00	
3.15 SPAIN GOVT 160131	2,200,000.00	2,294,820.00	
3.2 AUSTRIA GOVT 170220	1,100,000.00	1,188,055.00	
3.25 BEL GOVT 160928	1,400,000.00	1,497,580.00	
3.25 BUND 150704	2,400,000.00	2,474,160.00	
3.25 BUND 200104	2,400,000.00	2,772,360.00	
3.25 BUND 210704	1,900,000.00	2,236,300.00	
3.25 BUND 420704	1,600,000.00	1,994,080.00	
3.25 NETH GOVT 150715	2,100,000.00	2,166,885.00	
3.25 NETH GOVT 210715	2,000,000.00	2,327,000.00	
3.25 O.A.T 160425	3,600,000.00	3,803,040.00	
3.25 O.A.T 211025	3,800,000.00	4,408,380.00	
3.25 O.A.T 450525	1,100,000.00	1,241,845.00	
3.25 SPAIN GOVT 160430	2,300,000.00	2,415,575.00	
3.3 SPAIN GOVT 160730	1,600,000.00	1,690,000.00	
3.375 FINNISH GOV 200415	600,000.00	693,720.00	
3.4 AUSTRIA GOVT 221122	1,000,000.00	1,181,700.00	
3.4 IRISH GOVT 240318	500,000.00	548,050.00	
3.5 AUSTRIA GOVT 150715	1,400,000.00	1,447,740.00	
3.5 AUSTRIA GOVT 210915	1,400,000.00	1,655,990.00	
3.5 BEL GOVT 170628	1,600,000.00	1,756,400.00	
3.5 BUND 160104	2,700,000.00	2,837,430.00	
3.5 BUND 190704	2,500,000.00	2,895,125.00	
3.5 FINNISH GOVT 210415	700,000.00	822,780.00	
3.5 ITALY GOVT 171101	2,000,000.00	2,162,700.00	
3.5 ITALY GOVT 180601	2,100,000.00	2,287,950.00	
3.5 ITALY GOVT 181201	1,800,000.00	1,972,980.00	
3.5 ITALY GOVT 300301	800,000.00	811,680.00	
3.5 NETH GOVT 200715	1,600,000.00	1,870,000.00	
3.5 O.A.T 200425	4,000,000.00	4,649,000.00	
3.5 O.A.T 260425	3,200,000.00	3,767,840.00	
3.65 AUSTRIA GOVT 220420	1,400,000.00	1,675,800.00	
3.75 BEL GOVT 150928	1,200,000.00	1,252,920.00	
3.75 BEL GOVT 200928	1,900,000.00	2,243,045.00	
3.75 BEL GOVT 450622	500,000.00	610,875.00	
3.75 BUND 170104	2,300,000.00	2,511,025.00	
3.75 BUND 190104	2,900,000.00	3,356,605.00	
3.75 ITALY GOVT 150801	2,700,000.00	2,793,015.00	
3.75 ITALY GOVT 160415	2,200,000.00	2,322,980.00	
3.75 ITALY GOVT 160801	3,200,000.00	3,403,200.00	
3.75 ITALY GOVT 210301	2,800,000.00	3,115,560.00	
3.75 ITALY GOVT 210501	1,300,000.00	1,443,325.00	
3.75 ITALY GOVT 210801	2,900,000.00	3,220,595.00	
3.75 ITALY GOVT 240901	300,000.00	324,915.00	
3.75 NETH GOVT 230115	1,300,000.00	1,574,820.00	
3.75 NETH GOVT 420115	1,600,000.00	2,139,440.00	
3.75 O.A.T 170425	4,000,000.00	4,401,000.00	



3.75 O.A.T 191025	3,500,000.00	4,088,350.00	
3.75 O.A.T 210425	3,900,000.00	4,641,780.00	
3.75 SPAIN GOVT 151031	1,700,000.00	1,774,460.00	
3.75 SPAIN GOVT 181031	2,300,000.00	2,552,655.00	
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	400,000.00	571,660.00	
3.8 SPAIN GOVT 170131	2,400,000.00	2,591,160.00	
3.8 SPAIN GOVT 240430	2,400,000.00	2,631,960.00	
3.875 FINNISH GOVT170915	800,000.00	893,800.00	
3.9 AUSTRIA GOVT 200715	1,600,000.00	1,906,880.00	
3.9 IRISH GOVT 230320	700,000.00	802,725.00	
4 AUSTRIA GOVT 160915	1,300,000.00	1,410,240.00	
4 BEL GOVT 170328	1,100,000.00	1,214,235.00	
4 BEL GOVT 180328	1,600,000.00	1,819,360.00	
4 BEL GOVT 190328	1,200,000.00	1,397,460.00	
4 BEL GOVT 220328	1,600,000.00	1,940,480.00	
4 BEL GOVT 320328	800,000.00	991,600.00	
4 BUND 160704	3,200,000.00	3,448,480.00	
4 BUND 180104	2,300,000.00	2,611,535.00	
4 BUND 370104	2,400,000.00	3,233,640.00	
4 FINNISH GOVT 250704	600,000.00	750,390.00	
4 ITALY GOVT 170201	2,900,000.00	3,136,205.00	
4 ITALY GOVT 200901	2,900,000.00	3,279,465.00	
4 ITALY GOVT 370201	2,600,000.00	2,738,840.00	
4 NETH GOVT 160715	1,900,000.00	2,048,770.00	
4 NETH GOVT 180715	2,200,000.00	2,526,590.00	
4 NETH GOVT 190715	1,600,000.00	1,881,600.00	
4 NETH GOVT 370115	1,500,000.00	2,012,775.00	
4 O.A.T 180425	3,100,000.00	3,536,945.00	
4 O.A.T 381025	2,500,000.00	3,182,125.00	
4 O.A.T 550425	1,600,000.00	2,112,960.00	
4 O.A.T 600425	1,200,000.00	1,594,560.00	
4 SPAIN GOVT 150730	2,100,000.00	2,179,590.00	
4 SPAIN GOVT 200430	2,200,000.00	2,496,560.00	
4.1 SPAIN GOVT 180730	2,600,000.00	2,916,680.00	
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	1,500,000.00	2,027,475.00	
4.2 SPAIN GOVT 370131	1,700,000.00	1,815,685.00	
4.25 BEL GOVT 210928	1,500,000.00	1,838,400.00	
4.25 BEL GOVT 220928	1,800,000.00	2,222,820.00	
4.25 BEL GOVT 410328	1,700,000.00	2,242,300.00	
4.25 BUND 170704	2,100,000.00	2,360,715.00	
4.25 BUND 180704	2,800,000.00	3,254,440.00	
4.25 BUND 390704	1,600,000.00	2,276,560.00	
4.25 FINNISH GOVT 150704	600,000.00	624,240.00	
4.25 ITALY GOVT 190201	2,800,000.00	3,168,340.00	
4.25 ITALY GOVT 190901	2,900,000.00	3,305,130.00	
4.25 ITALY GOVT 200301	2,700,000.00	3,086,505.00	
4.25 O.A.T 171025	3,300,000.00	3,738,405.00	
4.25 O.A.T 181025	3,000,000.00	3,498,600.00	
4.25 O.A.T 190425	3,300,000.00	3,897,135.00	
4.25 O.A.T 231025	3,500,000.00	4,375,175.00	
4.25 SPAIN GOVT 161031	2,400,000.00	2,598,960.00	
4.3 AUSTRIA GOVT 170915	900,000.00	1,017,270.00	
4.3 SPAIN GOVT 191031	2,400,000.00	2,757,240.00	
4.35 AUSTRIA GOVT 190315	1,400,000.00	1,657,390.00	
4.375 FINNISH GOV 190704	300,000.00	357,735.00	
4.4 IRISH GOVT 190618	800,000.00	937,600.00	
4.4 SPAIN GOVT 231031	1,900,000.00	2,186,235.00	
4.5 BEL GOVT 260328	800,000.00	1,021,600.00	
4.5 IRISH GOVT 181018	900,000.00	1,045,215.00	
4.5 IRISH GOVT 200418	1,200,000.00	1,423,800.00	
4.5 ITALY GOVT 150715	1,900,000.00	1,976,475.00	
4.5 ITALY GOVT 180201	2,500,000.00	2,800,000.00	
4.5 ITALY GOVT 180801	2,900,000.00	3,283,380.00	
4.5 ITALY GOVT 190301	2,500,000.00	2,861,250.00	
4.5 ITALY GOVT 200201	2,300,000.00	2,657,420.00	
4.5 ITALY GOVT 230501	2,000,000.00	2,302,100.00	
4.5 ITALY GOVT 240301	2,200,000.00	2,535,060.00	

4.5 ITALY GOVT 260301	2,300,000.00	2,632,465.00	
4.5 NETH GOVT 170715	1,700,000.00	1,921,340.00	
4.5 O.A.T 410425	2,500,000.00	3,450,625.00	
4.5 SPAIN GOVT 180131	2,600,000.00	2,922,920.00	
4.6 IRISH GOVT 160418	1,100,000.00	1,185,690.00	
4.6 SPAIN GOVT 190730	1,800,000.00	2,088,540.00	
4.65 AUSTRIA GOVT 180115	1,800,000.00	2,079,270.00	
4.65 SPAIN GOVT 250730	1,700,000.00	1,975,145.00	
4.7 SPAIN GOVT 410730	1,300,000.00	1,465,425.00	
4.75 BUND 280704	1,300,000.00	1,801,605.00	
4.75 BUND 340704	2,100,000.00	3,051,405.00	
4.75 BUND 400704	1,700,000.00	2,609,075.00	
4.75 ITALY GOVT 160915	2,200,000.00	2,392,610.00	
4.75 ITALY GOVT 170501	1,300,000.00	1,439,490.00	
4.75 ITALY GOVT 170601	1,600,000.00	1,775,120.00	
4.75 ITALY GOVT 210901	2,600,000.00	3,059,160.00	
4.75 ITALY GOVT 230801	2,800,000.00	3,288,880.00	
4.75 ITALY GOVT 280901	1,900,000.00	2,202,100.00	
4.75 ITALY GOVT 440901	1,500,000.00	1,704,675.00	
4.75 O.A.T 350425	2,300,000.00	3,189,640.00	
4.8 SPAIN GOVT 240131	1,500,000.00	1,773,600.00	
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	800,000.00	1,075,360.00	
4.85 SPAIN GOVT 201031	2,200,000.00	2,614,150.00	
4.9 SPAIN GOVT 400730	1,400,000.00	1,634,150.00	
5 BEL GOVT 350328	2,100,000.00	2,959,950.00	
5 IRISH GOVT 201018	1,000,000.00	1,224,900.00	
5 ITALY GOVT 220301	2,000,000.00	2,383,000.00	
5 ITALY GOVT 250301	3,000,000.00	3,573,300.00	
5 ITALY GOVT 340801	2,400,000.00	2,858,280.00	
5 ITALY GOVT 390801	2,000,000.00	2,368,300.00	
5 ITALY GOVT 400901	2,300,000.00	2,707,560.00	
5 O.A.T 161025	3,400,000.00	3,779,270.00	
5.15 SPAIN GOVT 281031	1,100,000.00	1,317,965.00	
5.15 SPAIN GOVT 441031	500,000.00	597,175.00	
5.25 ITALY GOVT 170801	2,700,000.00	3,049,245.00	
5.25 ITALY GOVT 291101	3,100,000.00	3,770,685.00	
5.4 IRISH GOVT 250313	1,300,000.00	1,658,020.00	
5.4 SPAIN GOVT 230131	1,900,000.00	2,337,380.00	
5.5 BEL GOVT 170928	900,000.00	1,051,785.00	
5.5 BEL GOVT 280328	1,900,000.00	2,681,375.00	
5.5 BUND 310104	1,900,000.00	2,880,875.00	
5.5 IRISH GOVT 171018	700,000.00	814,835.00	
5.5 ITALY GOVT 220901	2,200,000.00	2,700,280.00	
5.5 ITALY GOVT 221101	2,300,000.00	2,822,675.00	
5.5 NETH GOVT 280115	1,400,000.00	2,036,160.00	
5.5 O.A.T 290425	3,100,000.00	4,442,145.00	
5.5 SPAIN GOVT 170730	2,100,000.00	2,393,055.00	
5.5 SPAIN GOVT 210430	2,600,000.00	3,198,260.00	
5.625 BUND 280104	1,400,000.00	2,080,610.00	
5.75 ITALY GOVT 330201	1,800,000.00	2,328,030.00	
5.75 O.A.T 321025	2,700,000.00	4,102,515.00	
5.75 SPAIN GOVT 320730	1,600,000.00	2,066,560.00	
5.85 SPAIN GOVT 220131	1,900,000.00	2,391,530.00	
5.9 IRISH GOVT 191018	800,000.00	1,005,120.00	
5.9 SPAIN GOVT 260730	1,300,000.00	1,657,825.00	
6 BUND 160620	300,000.00	334,245.00	
6 ITALY GOVT 310501	3,100,000.00	4,085,335.00	
6 O.A.T 251025	1,800,000.00	2,588,220.00	
6 SPAIN GOVT 290131	2,200,000.00	2,850,540.00	
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	800,000.00	1,222,320.00	
6.25 BUND 240104	1,300,000.00	1,905,995.00	
6.25 BUND 300104	1,000,000.00	1,604,200.00	
6.5 BUND 270704	1,100,000.00	1,744,435.00	
6.5 ITALY GOVT 271101	3,100,000.00	4,202,360.00	
7.25 ITALY GOVT 261101	1,000,000.00	1,422,700.00	
8.5 O.A.T 191025	1,000,000.00	1,416,350.00	
8.5 O.A.T 230425	1,200,000.00	1,922,640.00	

9 ITALY GOVT 231101	1,500,000.00	2,295,600.00	
国債証券 小計	476,700,000.00	548,677,580.00 (75,454,140,801)	
ユーロ 小計	476,700,000.00	548,677,580.00 (75,454,140,801)	
合 計		168,504,879,523 (168,504,879,523)	

(注1) 通貨の種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

## 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 201銘柄	100.00%	37.77%
カナダドル	国債証券 29銘柄	100.00%	2.29%
オーストラリアドル	国債証券 17銘柄	100.00%	1.70%
イギリスポンド	国債証券 39銘柄	100.00%	8.19%
スイスフラン	国債証券 8銘柄	100.00%	0.35%
シンガポールドル	国債証券 16銘柄	100.00%	0.38%
マレーシアリングgit	国債証券 25銘柄	100.00%	0.55%
スウェーデンクローネ	国債証券 9銘柄	100.00%	0.57%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	100.00%	0.29%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.00%	0.81%
メキシコペソ	国債証券 19銘柄	100.00%	1.11%
ポーランドズロチ	国債証券 17銘柄	100.00%	0.70%
南アフリカランド	国債証券 12銘柄	100.00%	0.50%
ユーロ	国債証券 266銘柄	100.00%	44.78%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
(デリバティブ取引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26年7月31日現在

(単位:円)

資産総額	1,309,259,634
負債総額	483,444
純資産総額( - )	1,308,776,190
発行済口数	1,421,284,562 口
1口当たり純資産価額( / )	0.9208 ( 1万口当たり 9,208 )

## &lt;参考&gt;

## 「三菱UFJ 外国債券マザーファンド」の現況

## 純資産額計算書

平成26年7月31日現在

(単位:円)

資産総額	170,373,075,142
負債総額	575,281,652
純資産総額( - )	169,797,793,490
発行済口数	68,784,734,257 口
1口当たり純資産価額( / )	2.4685 ( 1万口当たり 24,685 )

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### （1）名義書換

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

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

### （2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

### （3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

### （4）受益権の譲渡

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

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

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

### （5）受益権の譲渡の対抗要件

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

### （6）受益権の再分割

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

### （7）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額等

平成26年7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。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

##### (2) 委託会社の機構

###### ・会社の意思決定機構

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

###### ・投資運用の意思決定機構

###### 投資環境見通しの策定

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

###### 運用戦略の決定

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

###### 運用計画の決定

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

###### ポートフォリオの構築

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

###### 投資行動のモニタリング1

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

###### 投資行動のモニタリング2

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

###### ファンドに関係する法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に関係する法人については、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、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26年7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	501	7,092,090
追加型公社債投資信託	18	707,986
単位型株式投資信託	25	446,252
単位型公社債投資信託	5	157,377
合計	549	8,403,705

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。）に基づいて作成しております。

なお、当事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表に含まれる比較情報については、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成24年9月21日内閣府令第61号）附則第2条第2項により、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

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

#### (2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第29期事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第28期 (平成25年3月31日現在)		第29期 (平成26年3月31日現在)	
<b>(資産の部)</b>				
<b>流動資産</b>				
現金及び預金	2	22,261,065	2	33,576,940
有価証券	2	8,000,000		120,983
前払費用		159,117		166,599
未収入金		5,504		168,410
未収委託者報酬		4,489,181		6,895,748
未収収益	2	47,936	2	64,325
繰延税金資産		402,791		399,128
金銭の信託	2	30,000	2	30,000
その他		39,167		111,434
流動資産合計		35,434,764		41,533,570
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
建物	1	270,058	1	254,682
器具備品	1	171,754	1	178,962
土地		1,205,031		1,205,031
有形固定資産合計		1,646,844		1,638,676
<b>無形固定資産</b>				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		857,424		1,147,522
ソフトウェア仮勘定		430,432		105,254
無形固定資産合計		1,303,679		1,268,599
<b>投資その他の資産</b>				
投資有価証券		15,689,317		19,370,921
関係会社株式		320,136		320,136
長期性預金	2	3,500,000		
長期差入保証金	2	825,804	2	813,838
その他		15,035		15,035
投資その他の資産合計		20,350,294		20,519,931
固定資産合計		23,300,818		23,427,207
資産合計		58,735,583		64,960,778

(単位：千円)

	第28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
<b>(負債の部)</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	75,221	270,374
未払金		
未払収益分配金	33,936	62,872
未払償還金	1,004,879	927,297
未払手数料	2 1,761,746	2 2,914,613
その他未払金	84,763	56,199
未払費用	2 1,333,574	2 1,623,932
未払消費税等	128,077	266,187
未払法人税等	1,686,070	2,228,949
賞与引当金	594,000	585,962
その他	348,389	383,684
流動負債合計	7,050,661	9,320,074
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	119,776	154,690
役員退職慰労引当金	65,103	63,000
時効後支払損引当金	201,877	226,128
繰延税金負債	251,776	253,904
固定負債合計	638,533	697,725
負債合計	7,689,194	10,017,799
<b>(純資産の部)</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000,131	2,000,131
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
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	39,686,216	43,710,993
利益剰余金合計	47,026,806	51,051,583
株主資本合計	49,249,033	53,273,811

(単位：千円)

	第28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
評価・換算差額等		
その他有価証券 評価差額金	1,797,355	1,669,167
評価・換算差額等合計	1,797,355	1,669,167
純資産合計	51,046,388	54,942,978
負債純資産合計	58,735,583	64,960,778

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第28期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		第29期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		48,411,166		53,423,757
投資顧問料		13,601		139,837
その他営業収益		138,788		99,673
営業収益合計		48,563,556		53,663,268
営業費用				
支払手数料	2	19,724,426	2	21,905,982
広告宣伝費		543,508		694,552
公告費		1,748		1,062
調査費				
調査費		942,478		977,602
委託調査費		10,699,987		11,329,088
事務委託費		242,537		263,721
営業雑経費				
通信費		89,308		97,901
印刷費		443,177		510,065
協会費		39,963		40,060
諸会費		7,621		7,806
事務機器関連費		971,457		1,041,363
その他営業雑経費		8,989		12,477
営業費用合計		33,715,204		36,881,683
一般管理費				
給料				
役員報酬		198,915		205,947
給料・手当		3,740,875		3,814,639
賞与引当金繰入		594,000		585,962
福利厚生費		593,073		603,032
交際費		23,259		21,433
旅費交通費		139,968		143,037
租税公課		115,450		123,549
不動産賃借料		699,860		692,573
退職給付費用		162,650		256,292
役員退職慰労引当金繰入		19,007		20,252
固定資産減価償却費		442,844		467,545
諸経費		270,874		300,280
一般管理費合計		7,000,782		7,234,545
営業利益		7,847,569		9,547,039

(単位：千円)

	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)		第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		213,088		287,886
有価証券利息	2	6,698	2	3,249
受取利息	2	25,684	2	19,503
投資有価証券償還益		6,072		1,862
収益分配金等時効完成分		412,323		64,449
その他		1,935		2,886
営業外収益合計		665,802		379,836
営業外費用				
投資有価証券償還損		8,689		57
時効後支払損引当金繰入		16,881		49,112
事務過誤費		186		1,389
その他		45		4,097
営業外費用合計		25,802		54,656
経常利益		8,487,569		9,872,219
特別利益				
投資有価証券売却益		334,775		767,140
特別利益合計		334,775		767,140
特別損失				
投資有価証券売却損		32,155		49,266
固定資産除却損	1	253	1	466
特別損失合計		32,409		49,732
税引前当期純利益		8,789,934		10,589,626
法人税、住民税及び事業税		3,441,310		3,847,871
法人税等調整額		55,499		11,641
法人税等合計		3,385,811		3,859,512
当期純利益		5,404,123		6,730,113

## (3)【株主資本等変動計算書】

第28期（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日 ）

(単位：千円)

	株主資本							株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		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		
当期首残高	2,000,131	222,096	222,096	342,589	6,998,000	36,863,331	44,203,921	46,426,148
当期変動額								
剰余金の配当						2,581,238	2,581,238	2,581,238
当期純利益						5,404,123	5,404,123	5,404,123
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）								
当期変動額合計						2,822,884	2,822,884	2,822,884
当期末残高	2,000,131	222,096	222,096	342,589	6,998,000	39,686,216	47,026,806	49,249,033

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	723,054	723,054	47,149,203
当期変動額			
剰余金の配当			2,581,238
当期純利益			5,404,123
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,074,300	1,074,300	1,074,300
当期変動額合計	1,074,300	1,074,300	3,897,185
当期末残高	1,797,355	1,797,355	51,046,388

第29期（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日 ）

（単位：千円）

	株主資本							株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益 準備金	利益剰余金		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		
当期首残高	2,000,131	222,096	222,096	342,589	6,998,000	39,686,216	47,026,806	49,249,033
当期変動額								
剰余金の配当						2,705,336	2,705,336	2,705,336
当期純利益						6,730,113	6,730,113	6,730,113
株主資本以外の 項目の当期 変動額（純額）								
当期変動額合計						4,024,777	4,024,777	4,024,777
当期末残高	2,000,131	222,096	222,096	342,589	6,998,000	43,710,993	51,051,583	53,273,811

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,797,355	1,797,355	51,046,388
当期変動額			
剰余金の配当			2,705,336
当期純利益			6,730,113
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	128,187	128,187	128,187
当期変動額合計	128,187	128,187	3,896,589
当期末残高	1,669,167	1,669,167	54,942,978



## [注記事項]

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

## (2) その他有価証券

## 時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

## 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は、建物38年であります。

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。

## 3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

## 4. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

## 退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。

## 数理計算上の差異の費用処理方法

数理計算上の差異は、その発生年度の翌事業年度より一括費用処理することとしております。

## (会計上の見積もりの変更)

数理計算上の差異は、従来、発生年度の従業員の平均支払期間内の一定の年数(8年)により費用処理していましたが、当事業年度において、平均支払期間が8年を下回ったことから、数理計算上の差異を一括費用処理する方法に見直し、将来にわたり変更しております。

これにより、従来の方と比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税金等調整前当期純利益はそれぞれ87百万円減少しております。

## (3) 役員退職慰労引当金

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

## (4) 時効後支払損引当金

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

## 5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## (1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

## (未適用の会計基準等)

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日）

## (1) 概要

未認識数理計算上の差異及び未認識過去勤務費用の処理方法、退職給付債務及び勤務費用の計算方法並びに開示の拡充等について改正されました。

## (2) 適用予定日

退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正については、平成27年3月期の期首から適用します。なお、当該会計基準等には経過的な取り扱いが定められているため、過去の期間の財務諸表に対しては遡及適用しません。

## (3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等を適用することにより、翌事業年度の期首の繰延税金資産は4,225千円増加し、退職給付引当金は11,857千円増加し、繰越利益剰余金は7,631千円減少しております。

## (貸借対照表関係)

## 1.有形固定資産の減価償却累計額

	第28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
建物	233,990千円	258,119千円
器具備品	351,481千円	374,405千円

## 2.関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
預金	19,410,015千円	30,782,482千円
有価証券	8,000,000千円	-
未収収益	40,120千円	34,750千円
金銭の信託	30,000千円	30,000千円
長期性預金	3,500,000千円	-
長期差入保証金	816,823千円	804,456千円
未払手数料	927,107千円	1,802,448千円
未払費用	148,712千円	171,067千円

## (損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

	第28期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第29期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
器具備品	253千円	466千円
計	253千円	466千円

## 2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第28期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第29期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
支払手数料	10,230,968千円	11,642,746千円
有価証券利息	5,170千円	2,051千円
受取利息	25,684千円	19,503千円

## (株主資本等変動計算書関係)

第28期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数 (株)	当事業年度増加 株式数 (株)	当事業年度減少 株式数 (株)	当事業年度末 株式数 (株)
発行済株式				
普通株式	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24年6月26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	2,581,238千円
1株当たり配当額	20,800円
基準日	平成24年3月31日
効力発生日	平成24年6月27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25年6月24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	2,705,336千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	21,800円
基準日	平成25年3月31日
効力発生日	平成25年6月25日

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	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25年6月24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	2,705,336千円
1株当たり配当額	21,800円
基準日	平成25年3月31日
効力発生日	平成25年6月25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26年6月27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	3,375,465千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	27,200円
基準日	平成26年3月31日
効力発生日	平成26年6月30日

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、譲渡性預金または投資信託に限定しており、金融機関からの資金調達は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

## 第28期（平成25年3月31日現在）

	貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 現金及び預金	22,261,065	22,261,065	-
(2) 有価証券	8,000,000	8,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	4,489,181	4,489,181	-
(4) 長期性預金	3,500,000	3,505,795	5,795
(5) 投資有価証券	15,650,417	15,650,417	-
資産計	53,900,663	53,906,459	5,795
(1) 未払手数料	1,761,746	1,761,746	-
(2) 未払法人税等	1,686,070	1,686,070	-
負債計	3,447,816	3,447,816	-

## 第29期（平成26年3月31日現在）

	貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 現金及び預金	33,576,940	33,576,940	-
(2) 有価証券	120,983	120,983	-
(3) 未収委託者報酬	6,895,748	6,895,748	-
(4) 長期性預金	-	-	-
(5) 投資有価証券	19,332,021	19,332,021	-
資産計	59,925,694	59,925,694	-
(1) 未払手数料	2,914,613	2,914,613	-
(2) 未払法人税等	2,228,949	2,228,949	-
負債計	5,143,563	5,143,563	-

## （注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資 産

## (1) 現金及び預金、(2) 有価証券、(3) 未収委託者報酬

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

## (4) 長期性預金

契約期間に基づく区分ごとに、新規に預金を行った場合に想定される預金金利で割り引いた現在価値を算定しております。

## (5) 投資有価証券

上記の表中における投資有価証券はすべて投資信託であり、基準価額によっております。

負 債

## (1) 未払手数料、(2) 未払法人税等

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

区分	第28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
非上場株式	38,900	38,900
子会社株式	160,600	160,600
関連会社株式	159,536	159,536

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 投資有価証券」には含めておりません。

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第28期(平成25年3月31日現在)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	22,261,065	-	-	-
未収委託者報酬	4,489,181	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
譲渡性預金	8,000,000	-	-	-
投資信託	-	4,150,204	2,167,462	2,151,428
長期性預金	-	3,500,000	-	-
合計	34,750,246	7,650,204	2,167,462	2,151,428

第29期(平成26年3月31日現在)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	33,576,940	-	-	-
未収委託者報酬	6,895,748	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
譲渡性預金	-	-	-	-
投資信託	120,983	3,103,140	6,128,025	1,408,595
長期性預金	-	-	-	-
合計	40,593,672	3,103,140	6,128,025	1,408,595

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 2. その他有価証券

第28期(平成25年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	12,625,086	10,181,990	2,443,096
	小計	12,625,086	10,181,990	2,443,096
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	3,025,331	3,033,767	8,436
	小計	3,025,331	3,033,767	8,436
合計		15,650,417	13,215,757	2,434,660

第29期(平成26年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	16,263,940	13,940,367	2,323,572
	小計	16,263,940	13,940,367	2,323,572
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	3,189,065	3,212,015	22,950
	小計	3,189,065	3,212,015	22,950
合計		19,453,005	17,152,382	2,300,622

## 3. 売却したその他有価証券

第28期(自平成24年4月1日至平成25年3月31日)

種類	売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他	7,033,368	334,775	32,155
合計	7,033,368	334,775	32,155

第29期(自平成25年4月1日至平成26年3月31日)

種類	売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他	3,836,955	767,140	49,266
合計	3,836,955	767,140	49,266

(デリバティブ取引関係)  
重要な取引はありません。

(退職給付関係)  
第28期(自平成24年4月1日至平成25年3月31日)

1.採用している退職給付制度の概要

当社は、従業員に対して確定拠出年金制度、退職一時金制度及び確定給付年金制度を設けております。

2.退職給付債務に関する事項

(1) 退職給付債務(千円)	382,988
(2) 年金資産(千円)	143,462
(3) 未積立退職給付債務 (1)+(2)(千円)	239,525
(4) 未認識数理計算上の差異(千円)	119,749
(5) 貸借対照表計上額純額 (3)+(4)(千円)	119,776
(6) 退職給付引当金(千円)	119,776

3.退職給付費用に関する事項

(1) 勤務費用(千円)	26,748
(2) 利息費用(千円)	7,087
(3) 期待運用収益(千円)	2,984
(4) 数理計算上の差異の費用処理額(千円)	27,653
(5) その他(千円)	104,146
(6) 退職給付費用(1)+(2)+(3)+(4)+(5)(千円)	162,650

(注)「(5)その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

4.退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

(1)退職給付見込額の期間配分方法

期間定額基準

(2)割引率

1.5%

(3)期待運用収益率

1.5%

(4)数理計算上の差異の処理年数

8年(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。)



第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

1.採用している退職給付制度の概要

当社は、従業員に対して確定拠出年金制度、退職一時金制度及び確定給付年金制度を設けております。

2.確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	382,988千円
勤務費用	425
利息費用	5,724
数理計算上の差異の発生額	432
退職給付の支払額	75,066
<u>退職給付債務の期末残高</u>	<u>313,639</u>

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	143,462千円
期待運用収益	2,151
数理計算上の差異の発生額	3,824
事業主からの拠出額	88,833
退職給付の支払額	75,066
<u>年金資産の期末残高</u>	<u>163,205</u>

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

積立型制度の退職給付債務	311,889千円
年金資産	163,205
	<u>148,683</u>
非積立型制度の退職給付債務	1,750
未認識数理計算上の差異	4,257
<u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u>	<u>154,690</u>
退職給付引当金	154,690
<u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u>	<u>154,690</u>

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	425千円
利息費用	5,724
期待運用収益	2,151
数理計算上の差異の費用処理額	119,749
その他	25,147
<u>確定給付制度に係る退職給付費用</u>	<u>148,895</u>

（注）「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額です。

## (5)年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

債券	31.1%
株式	13.1
その他	55.8
合計	100

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6)数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 1.5%

長期期待運用収益率 1.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は107,397千円でありました。

## （税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
<b>繰延税金資産</b>		
減損損失	542,460 千円	527,037 千円
投資有価証券評価損	226,404	42,394
ゴルフ会員権評価損	8,505	8,505
未払事業税	140,336	154,726
賞与引当金	225,779	208,836
役員退職慰労引当金	23,202	22,453
退職給付引当金	45,495	55,131
減価償却超過額	10,083	10,659
委託者報酬	124,166	136,745
長期差入保証金	26,203	30,510
時効後支払損引当金	71,948	80,592
その他	48,666	41,232
繰延税金資産 小計	1,493,253	1,318,825
評価性引当額	704,932	542,145
繰延税金資産 合計	788,320	776,680
<b>繰延税金負債</b>		
その他有価証券評価差額金	637,305	631,455
その他	-	1
繰延税金負債 合計	637,305	631,456
繰延税金資産の純額	151,015	145,223

## 2. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異について、前事業年度の38.01%から35.64%に変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が29,724千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が29,724千円増加しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第28期（自平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）及び第29期（自平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）  
当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第28期（自平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）及び第29期（自平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第28期（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高	
親会社	三菱UFJ 信託銀行(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 50.0%	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	4,556,241 千円	未払手数料	324,725 千円	
							事務所の賃借	事務所賃借 料	671,086 千円	長期差入保 証金	812,027 千円
							投資の助言	投資助言料	167,142 千円	未払費用	85,301 千円
主要株主	(株)三菱東京 UFJ銀行	東京都 千代田 区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 25.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払	5,674,726 千円	未払手数料	602,382 千円	
							取引銀行	譲渡性預金 の預入	30,000,000 千円	有価証券	8,000,000 千円
								譲渡性預金 に係る受取 利息	5,170 千円	未収収益	717 千円
								マルチコーラ ブル預金の預 入	5,500,000 千円	現金及び 預金	10,500,000 千円
										長期性預金	3,500,000 千円
			マルチコーラ ブル預金に係 る受取利息	24,246 千円	未収収益	2,301 千円					

## 第29期(自平成25年4月1日至平成26年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 50.0%	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	4,507,475 千円	未払手数料	476,882 千円
						事務所の賃借	事務所賃借料	671,086 千円	長期差入保証金	799,941 千円
						投資の助言	投資助言料	190,144 千円	未払費用	99,131 千円
主要株主	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 25.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	7,135,270 千円	未払手数料	1,325,565 千円
						取引銀行	譲渡性預金の預入	14,000,000 千円		
							譲渡性預金に係る受取利息	2,051 千円		
							マルチコーポラブル預金の預入	6,500,000 千円	現金及び預金	10,000,000 千円
							マルチコーポラブル預金に係る受取利息	16,775 千円	未収収益	646 千円

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

事務所敷金及び賃借料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。

預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は3ヶ月～3年であります。

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

## (2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第28期(自平成24年4月1日至平成25年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱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	3,513,173 千円	未払手数料	321,822 千円

第29期(自平成25年4月1日至平成26年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱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	3,638,642 千円	未払手数料	544,991 千円

## (注)取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 2.親会社に関する注記

株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(東京証券取引所、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)

三菱UFJ信託銀行株式会社(非上場)

## (1株当たり情報)

	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	411,339.33円	442,738.63円
1株当たり当期純利益金額	43,547.22円	54,232.25円

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
当期純利益金額 (千円)	5,404,123	6,730,113
普通株主に帰属しない金額 (千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額 (千円)	5,404,123	6,730,113
期中平均株式数 (株)	124,098	124,098

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。



#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（平成26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26年3月末現在)	事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
カブドットコム証券株式会社	7,196 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	47,937 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
フィデリティ証券株式会社	5,957 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26年7月末現在）

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の50.0%（62,050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26年5月1日	臨時報告書
平成26年4月16日	有価証券報告書、有価証券届出書
平成26年2月3日	臨時報告書

# 独立監査人の監査報告書

平成26年6月27日

三菱UFJ投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	樋口 誠之	印
--------------------	-------	-------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山田 信之	印
--------------------	-------	-------	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ投信株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第29期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ投信株式会社の平成26年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

## 独立監査人の監査報告書

平成26年8月27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 公認会計士 柴 毅 印  
業務執行社員

指定社員 公認会計士 和田 渉 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ世界国債インデックスファンド（毎月分配型）の平成26年1月18日から平成26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。

### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ世界国債インデックスファンド（毎月分配型）の平成26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。

### 利害関係

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、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。