

**【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23年4月15日

**【計算期間】** 第3期（自平成22年1月19日 至 平成23年1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（年1回決算型）

**【発行者名】** 三菱UFJ投信株式会社

**【代表者の役職氏名】** 取締役社長 後藤 俊夫

**【本店の所在の場所】** 東京都千代田区丸の内一丁目4番5号

**【事務連絡者氏名】** 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、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、3,000億円です。

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

#### 商品分類表

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

#### 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式 一般	年1回 年2回	グローバル (日本を除く)	ファミリー ファンド	あり ( )	日経225	ブル・ベア型
大型株 中小型株 債券	年4回 年6回 (隔月)	日本 北米 欧州	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ( )	年12回 (毎月) 日々 その他 ( )	アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング			その他 (シティグ ループ世界 国債インデ ックス(除く 日本、円 ベース))	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型  その他 ( )
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (債券一般ク レジット属性 (高格付 債)))						
資産複合 ( )						

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

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

## 商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないうちファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。
	MRF（マネー・リザーブ・ファンド）	社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMRFをいいます。
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託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。

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

## 属性区分の定義

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

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

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

## [ 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

であるシティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)の動きに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

### シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)<sup>1</sup>に連動する投資成果をめざして運用を行います。

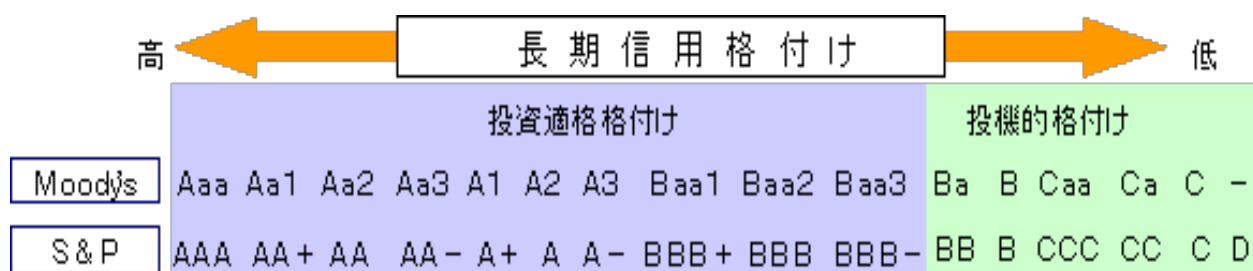
シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマーク<sup>2</sup>とします。

1 シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)とは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し指数化した債券インデックスです。当該指数は、以下の22ヵ国で構成されています(2011年1月末現在、国名は50音順)。ただし、構成国は変わる可能性があります。

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



ファンドが連動をめざすシティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は日本を除く世界主要国の国債(投資適格債)のみを対象としており、したがって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、組入れ国債等の利子・配当等収益を中心に分配を行う方針です。**

年1回(1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。

4

**原則として為替ヘッジを行いません。**

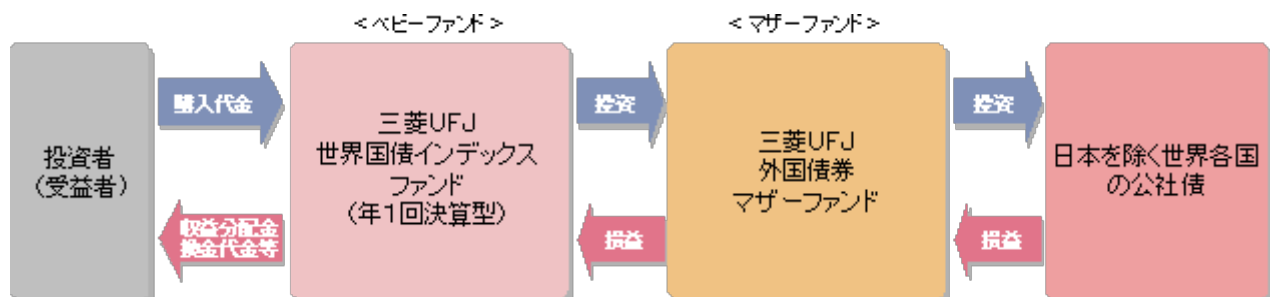
為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

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。

## &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。

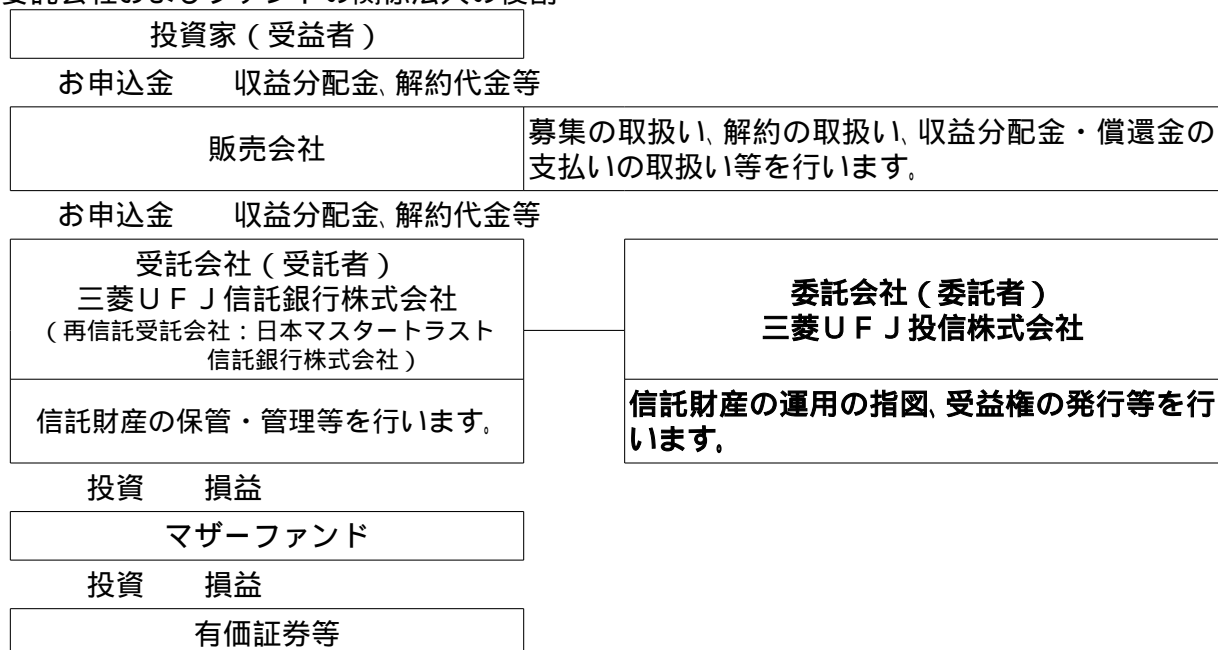
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

## (2) 【ファンドの沿革】

平成20年3月31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



## 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23年1月末現在）

## ・沿革

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

## ・大株主の状況（平成23年4月1日現在）

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、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果をめざ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。

対象インデックスとの連動を維持するため、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．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（新株引受権証書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または新優先出資引受権を表示する証券（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．資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第13号で定めるものをいいます。）

11．コマーシャル・ペーパー

12．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

13．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12．の証券または証書の性質を有するもの

14．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）

15．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。16．において同じ。）で16．で定めるもの以外のもの

16．投資法人債券（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。以下16．において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券

17. 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。)
  18. 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。)
  19. 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。)
  20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  21. 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。)
  22. 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。)
  23. 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
  24. 外国の者に対する権利で23.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13.および19.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16.の証券ならびに13.および19.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、14.および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

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

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

#### その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・ 外国為替予約取引

### <三菱UFJ 外国債券マザーファンドの概要>

#### (基本方針)

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

#### (運用方法)

##### 投資対象

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

##### 投資態度

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

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

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

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

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

#### (投資制限)

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

10%以下とします。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

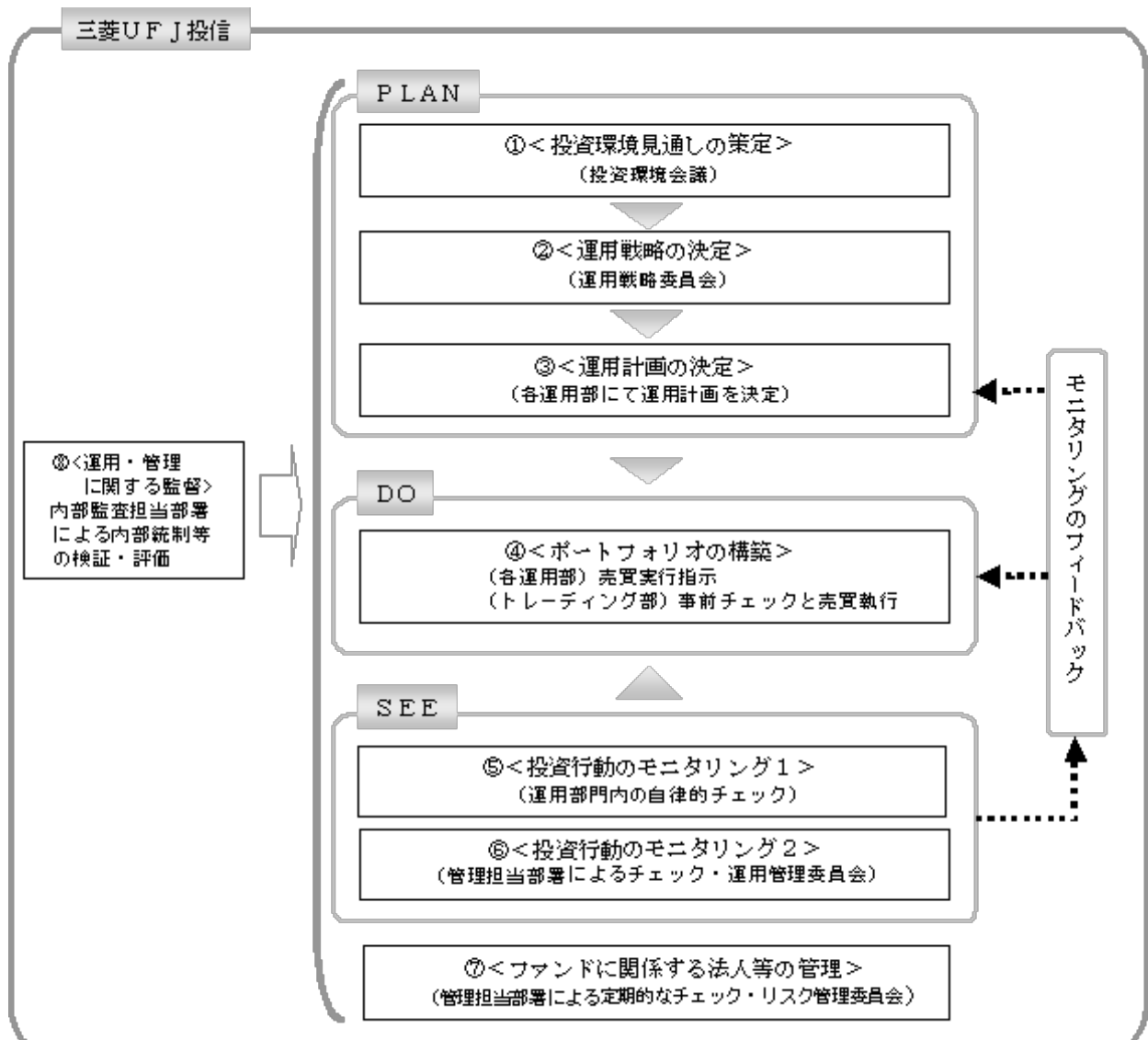
同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

### (3) 【運用体制】



#### 投資環境見通しの策定

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

#### 運用戦略の決定

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

#### 運用計画の決定

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

#### ポートフォリオの構築

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

#### 投資行動のモニタリング1

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

#### 投資行動のモニタリング2

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

#### ファンドに係る法人等の管理

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

#### 運用・管理に関する監督

内部監査担当部署(5名程度)は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

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

ファンドの運用体制等は平成23年4月16日現在のものであり、今後変更される可能性があります。

### (4) 【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

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

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

### (5) 【投資制限】

#### < 信託約款に定められた投資制限 >

##### 株式

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

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

##### 新株引受権証券および新株予約権証券

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

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

##### 投資信託証券

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

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

#### 同一銘柄の株式等

- a. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該株式の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- c. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- d. c. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

#### 同一銘柄の転換社債等

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

#### スワップ取引

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

#### 信用取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- b. a. の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内である場合においてできます。
- 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たときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. a. の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り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たときは、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、信託財産において有しない公社債またはの規定により借り入れた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、売り付けた公社債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。

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、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動することをめざして運用を行います。信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、債券先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比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おります。

各投資リスクに関する管理体制は以下の通りです。

#### 市場リスク

##### (価格変動リスク・為替変動リスク)

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

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

#### 信用リスク

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

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

#### 流動性リスク

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

申込手数料はかかりません。

### (2)【換金（解約）手数料】

解約手数料はかかりません。



換金の詳細については販売会社にご確認ください。

### （３）【信託報酬等】

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

信託財産の純資産総額 × 年0.63%（税抜 年0.6%）

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0.3255% (税抜 年0.31%)	年0.252% (税抜 年0.24%)	年0.0525% (税抜 年0.05%)

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

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

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】

個人の受益者に対する課税

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

#### １．収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。特別分配金（受益者の元本の一部払戻しに相当する部分）は課税されません。

原則として、10%（所得税7%および地方税3%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（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。申告分離課税を選択した場合、10%（所得税7%および地方税3%）の税率となります。

#### ２．解約時および償還時の課税

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

10%（所得税7%および地方税3%）の税率による申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、10%（所得税7%および地方税3%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として7%（所得税7%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。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。平成23年12月31日まで適用される税率です。平成24年以降は、15%（所得税15%）の税率となる予定です。

#### 個別元本について

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

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

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

#### 収益分配金について

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

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

税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

課税上の取扱いの詳細については、税務署等にご確認ください。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

平成23年1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	2,405,339,535	100.00
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		77,934	0.00
純資産総額		2,405,261,601	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23年1月31日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数 (口)	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	三菱UFJ 外国債券マザー ファンド	親投資信託 受益証券		1,448,737,900	1.6695 1.6603	2,418,787,836 2,405,339,535		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23年1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23年1月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額	基準価額 (1万口当たりの純資産価額)
第1計算期間末日 (平成21年1月19日)	1,187,848,551 (分配付) 1,186,463,035 (分配落)	8,565 (分配付) 8,555 (分配落)
第2計算期間末日 (平成22年1月18日)	2,050,783,232 (分配付) 2,048,549,444 (分配落)	9,181 (分配付) 9,171 (分配落)
第3計算期間末日 (平成23年1月17日)	2,392,896,805 (分配付) 2,390,003,025 (分配落)	8,269 (分配付) 8,259 (分配落)
平成22年1月末日	2,027,155,527	8,907
2月末日	2,067,681,532	8,776
3月末日	2,207,847,144	9,099
4月末日	2,262,335,271	9,148
5月末日	2,195,534,602	8,661
6月末日	2,196,313,390	8,431
7月末日	2,296,335,602	8,595
8月末日	2,311,037,383	8,469
9月末日	2,397,318,844	8,685
10月末日	2,347,178,598	8,415
11月末日	2,378,556,827	8,387
12月末日	2,314,797,820	8,063
平成23年1月末日	2,405,261,601	8,211

## 【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	10円
第2計算期間	10円
第3計算期間	10円

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	14.35
第2計算期間	7.31
第3計算期間	9.83

（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	1,778,146,051	391,356,354	1,386,789,697
第2計算期間	1,283,463,408	436,464,846	2,233,788,259
第3計算期間	1,096,279,075	436,287,216	2,893,780,118

<参考>

「三菱UFJ 外国債券マザーファンド」

## （1）投資状況

平成23年1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	85,564,110,112	39.73
	イタリア	21,646,192,856	10.05
	ドイツ	20,471,083,198	9.50
	フランス	20,333,069,620	9.44
	イギリス	16,523,926,557	7.67
	スペイン	8,739,367,695	4.06
	カナダ	6,089,107,947	2.83
	ベルギー	5,649,107,783	2.62
	オランダ	5,384,038,497	2.50
	オーストリア	3,756,553,754	1.74
	オーストラリア	2,330,572,410	1.08
	ポルトガル	2,032,308,164	0.94
	ポーランド	1,999,539,097	0.93
	メキシコ	1,897,686,534	0.88
	デンマーク	1,803,652,665	0.84
	アイルランド	1,644,438,301	0.76
	スウェーデン	1,445,439,314	0.67
	フィンランド	1,262,041,236	0.59
	マレーシア	1,151,912,081	0.53
スイス	1,138,619,839	0.53	
シンガポール	821,698,214	0.38	
ノルウェー	557,893,290	0.26	
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		3,129,373,789	1.47
純資産総額		215,371,732,953	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23年1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	3.125 T-NOTE 190515	国債証券		15,300,000.00	8,107.77 8,315.6625	1,240,488,953 1,272,296,362	3.125000 2019/05/15	0.59
アメリカ	3.375 T-NOTE 191115	国債証券		14,200,000.00	8,224.54 8,397.7925	1,167,886,033 1,192,486,535	3.375000 2019/11/15	0.55
アメリカ	3.625 T-NOTE 190815	国債証券		13,800,000.00	8,401.64 8,591.5679	1,159,426,643 1,185,636,379	3.625000 2019/08/15	0.55
アメリカ	3.625 T-NOTE 200215	国債証券		12,600,000.00	8,411.77 8,527.4039	1,059,883,748 1,074,452,892	3.625000 2020/02/15	0.50
アメリカ	2.75 T-NOTE 190215	国債証券		12,400,000.00	7,905.83 8,121.8870	980,323,391 1,007,113,991	2.750000 2019/02/15	0.47
アメリカ	3.75 T-NOTE 181115	国債証券		10,900,000.00	8,565.33 8,749.4115	933,621,809 953,685,860	3.750000 2018/11/15	0.44
アメリカ	3.5 T-NOTE 200515	国債証券		11,000,000.00	8,549.06 8,406.7754	940,396,902 924,745,301	3.500000 2020/05/15	0.43
アメリカ	2.625 T-NOTE 200815	国債証券		11,300,000.00	8,189.64 7,774.1178	925,429,658 878,475,312	2.625000 2020/08/15	0.41
アメリカ	2.625 T-NOTE 140630	国債証券		9,400,000.00	8,479.92 8,629.4248	797,112,715 811,165,931	2.625000 2014/06/30	0.38
イギリス	4.5 GILT 130307	国債証券		5,800,000.00	14,113.46 13,875.2693	818,580,917 804,765,619	4.500000 2013/03/07	0.37
アメリカ	2.375 T-NOTE 140930	国債証券		9,200,000.00	8,367.63 8,547.2948	769,822,459 786,351,121	2.375000 2014/09/30	0.37
イギリス	5 GILT 120307	国債証券		5,600,000.00	13,959.95 13,729.6986	781,757,642 768,863,121	5.000000 2012/03/07	0.36
アメリカ	2.375 T-NOTE 141031	国債証券		9,000,000.00	8,359.93 8,540.8784	752,394,216 768,679,056	2.375000 2014/10/31	0.36
イギリス	2.75 GILT 150122	国債証券		5,800,000.00	13,388.41 13,248.2355	776,528,154 768,397,659	2.750000 2015/01/22	0.36
イタリア	6 ITALY GOVT 310501	国債証券		6,300,000.00	12,909.06 11,984.6818	813,271,042 755,034,953	6.000000 2031/05/01	0.35
アメリカ	1.75 T-NOTE 120815	国債証券		9,000,000.00	8,365.71 8,383.6764	752,913,942 754,530,876	1.750000 2012/08/15	0.35
アメリカ	1.375 T-NOTE 121015	国債証券		8,900,000.00	8,286.14 8,336.8366	737,467,085 741,978,464	1.375000 2012/10/15	0.34
アメリカ	4.5 T-BOND 390815	国債証券		8,900,000.00	8,569.75 8,197.6006	762,707,944 729,586,455	4.500000 2039/08/15	0.34
イギリス	5.25 GILT 120607	国債証券		5,250,000.00	14,112.16 13,760.1396	740,888,568 722,407,332	5.250000 2012/06/07	0.34
アメリカ	1.375 T-NOTE 120515	国債証券		8,600,000.00	8,309.88 8,325.2871	714,650,348 715,974,694	1.375000 2012/05/15	0.33
フランス	4.25 O.A.T 190425	国債証券		6,000,000.00	12,395.40 11,895.3938	743,724,396 713,723,628	4.250000 2019/04/25	0.33
アメリカ	4.625 T-BOND 400215	国債証券		8,500,000.00	8,746.84 8,360.5773	743,481,825 710,649,073	4.625000 2040/02/15	0.33
アメリカ	2.375 T-NOTE 140831	国債証券		8,300,000.00	8,382.39 8,551.7862	695,738,629 709,798,258	2.375000 2014/08/31	0.33
アメリカ	1.5 T-NOTE 120715	国債証券		8,500,000.00	8,330.42 8,349.0278	708,085,723 709,667,364	1.500000 2012/07/15	0.33
アメリカ	1.375 T-NOTE 130115	国債証券		8,500,000.00	8,262.40 8,343.2530	702,304,540 709,176,512	1.375000 2013/01/15	0.33
アメリカ	1.375 T-NOTE 121115	国債証券		8,500,000.00	8,277.16 8,341.3281	703,558,945 709,012,890	1.375000 2012/11/15	0.33
アメリカ	2.5 T-NOTE 150430	国債証券		8,300,000.00	8,435.68 8,534.4619	700,161,686 708,360,344	2.500000 2015/04/30	0.33
イタリア	6.5 ITALY GOVT 271101	国債証券		5,600,000.00	13,638.74 12,624.2071	763,769,552 706,955,597	6.500000 2027/11/01	0.33
フランス	3 O.A.T 151025	国債証券		6,200,000.00	11,731.84 11,354.0853	727,374,647 703,953,288	3.000000 2015/10/25	0.33
イタリア	3.75 ITALY GOVT 160801	国債証券		6,300,000.00	11,699.56 11,090.6857	737,072,440 698,713,199	3.750000 2016/08/01	0.32

(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23年1月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	98.55
合計	98.55

（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。

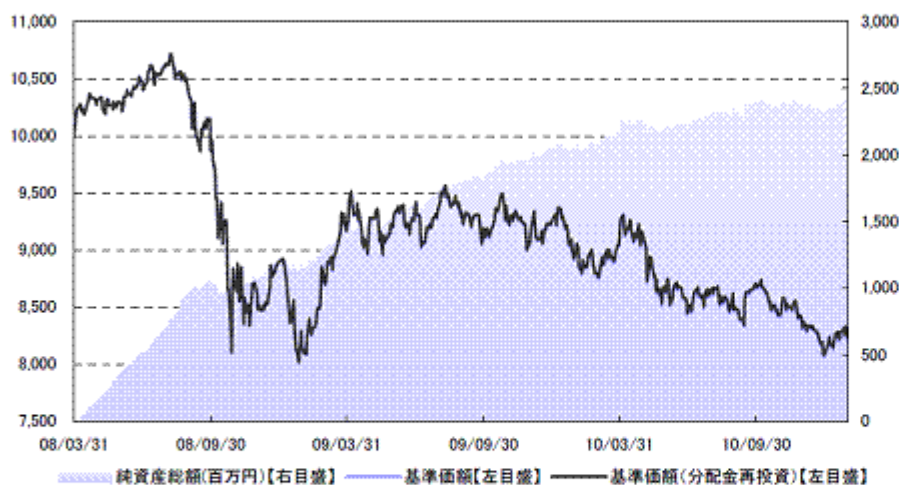
## その他投資資産の主要なもの

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～2011年01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

2011年 1月	10円
2010年 1月	10円
2009年 1月	10円
設定未累計	30円

・分配金は1万口当たり、税引前

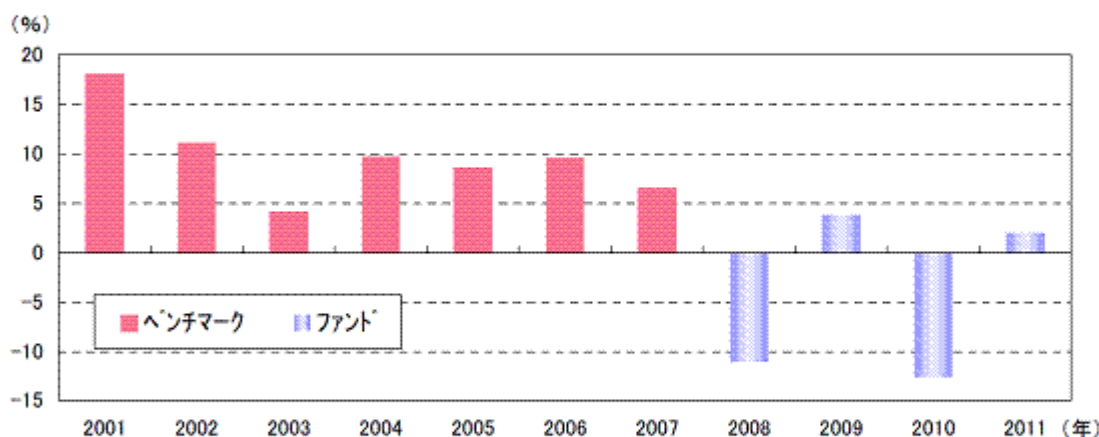
## 3 主要な資産の状況(2011年01月31日現在)

通貨別構成	比率
ユーロ	43.0%
アメリカドル	40.1%
イギリスポンド	7.8%
カナダドル	2.8%
オーストラリアドル	1.1%
ポーランドズロチ	1.0%
メキシコペソ	0.9%
デンマーククローネ	0.8%
その他	2.5%
合計	100.0%

	組入上位銘柄	種別	国・地域	比率
1	3.125 T-NOTE 190515	国債	アメリカ	0.6%
2	3.375 T-NOTE 191115	国債	アメリカ	0.6%
3	3.625 T-NOTE 190815	国債	アメリカ	0.6%
4	3.625 T-NOTE 200215	国債	アメリカ	0.5%
5	2.75 T-NOTE 190215	国債	アメリカ	0.5%
6	3.75 T-NOTE 181115	国債	アメリカ	0.4%
7	3.5 T-NOTE 200515	国債	アメリカ	0.4%
8	2.625 T-NOTE 200815	国債	アメリカ	0.4%
9	2.625 T-NOTE 140630	国債	アメリカ	0.4%
10	4.5 GILT 130307	国債	イギリス	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
- ・2008年は設定日から年末までの、2011年は1月31日までの収益率を表示
- ・2007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。当該時刻を過ぎての申込みは、翌営業日に受け付けたものとして取り扱います。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に取得申込みを締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。
その他	金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みを取り消すことがあります。

### 2【換金（解約）手続等】

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

#### (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20年3月31日から無期限 ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。
------	---

## (4) 【計算期間】

計算期間	原則として、毎年1月18日から翌年1月17日まで 上記にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日が休業日のとき、各計算期間終了日は、この該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日はファンドの信託期間終了日とします。
------	---

## (5) 【その他】

ファンドの償還条件等	委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。(任意償還) ・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合 ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃されたときまたはやむを得ない事情が発生したとき このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。 委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。
信託約款の変更等	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または受託会社を同一とする他ファンドとの併合を行うことができます。委託会社は、変更または併合しようとするときは、あらかじめその旨およびその内容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、信託約款の変更のうち重大な内容の変更または併合について、書面による決議(「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに任意償還等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、受益者に対し書面をもって書面決議の通知を發します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、受益者が議決権を行行使しないときは書面決議について賛成するものとみなします。書面決議は、議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上をもって行います。書面決議の効力は、ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。 併合に係るいずれかのファンドにおいて、書面決議が否決された場合、併合を行うことはできません。
反対者の買取請求権	委託会社がファンドの任意償還、信託約款について重大な内容の変更または併合を行う場合、書面決議において反対した受益者は、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。
関係法人との契約の更改	委託会社と販売会社との間で締結された「募集・販売の取扱い等に関する契約」の期間は、契約締結日から1ヵ年とし、期間満了3ヵ月前までに相手方に対し、何らの意思表示のないときは、同一の条件で契約を更新するものとし、その後も同様とします。
運用報告書の作成	委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、運用経過、信託財産の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更等があった場合は、その内容を運用報告書に記載します。

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い	委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。
受託会社の辞任および解任に伴う取扱い	受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。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。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。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、日本経済新聞に掲載します。

#### 4【受益者の権利等】

受益者の権利の主な内容は以下の通りです。

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。ただし、前計算期間については「投資信託及び投資法人に関する法律施行規則等の一部を改正する内閣府令」(平成21年内閣府令第35号)の附則第16条第2項本文を適用しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(平成21年1月20日から平成22年1月18日まで)および第3期計算期間(平成22年1月19日から平成23年1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（年1回決算型）

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 [平成22年1月18日現在]	第3期 [平成23年1月17日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	13,485,953	9,190,123
親投資信託受益証券	2,048,409,931	2,389,956,361
未収入金	2,643,600	2,760,200
未収利息	38	23
流動資産合計	2,064,539,522	2,401,906,707
資産合計	2,064,539,522	2,401,906,707
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	2,233,788	2,893,780
未払解約金	7,646,579	1,540,438
未払受託者報酬	498,216	618,750
未払委託者報酬	5,480,245	6,806,221
その他未払費用	131,250	44,493
流動負債合計	15,990,078	11,903,682
負債合計	15,990,078	11,903,682
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,233,788,259	1 2,893,780,118
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 185,238,815	2 503,777,093
（分配準備積立金）	72,839,593	125,750,049
元本等合計	2,048,549,444	2,390,003,025
純資産合計	2,048,549,444	2,390,003,025
負債純資産合計	2,064,539,522	2,401,906,707

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期 自平成21年1月20日 至平成22年1月18日	第3期 自平成22年1月19日 至平成23年1月17日
営業収益		
受取利息	5,676	5,949
有価証券売買等損益	102,900,918	215,427,570
営業収益合計	102,906,594	215,421,621
営業費用		
受託者報酬	868,159	1,183,768
委託者報酬	9,549,628	13,021,324
その他費用	262,500	85,111
営業費用合計	10,680,287	14,290,203
営業利益	92,226,307	229,711,824
経常利益	92,226,307	229,711,824
当期純利益	92,226,307	229,711,824
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	20,440,929	18,805,539
期首剰余金又は期首欠損金( )	200,326,662	185,238,815
剰余金増加額又は欠損金減少額	56,153,136	39,508,655
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	56,153,136	39,508,655
剰余金減少額又は欠損金増加額	110,616,879	144,246,868
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	110,616,879	144,246,868
分配金	2,233,788	2,893,780
期末剰余金又は期末欠損金( )	185,238,815	503,777,093

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第2期 (自平成21年1月20日 至平成22年1月18日)	第3期 (自平成22年1月19日 至平成23年1月17日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 親投資信託受益証券以外の有価証券 個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場で評価しております。</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年1月17日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成21年1月20日から平成22年1月18日までとなっております。</p>	<p>(1) 親投資信託受益証券 同左</p> <p>(2) 親投資信託受益証券以外の有価証券 同左</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 同左</p> <p>ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年1月17日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成22年1月19日から平成23年1月17日までとなっております。</p>
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項		

(貸借対照表に関する注記)

	第2期 [平成22年1月18日現在]	第3期 [平成23年1月17日現在]
1 期首元本額	1,386,789,697円	2,233,788,259円
期中追加設定元本額	1,283,463,408円	1,096,279,075円
期中一部解約元本額	436,464,846円	436,287,216円
2 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	185,238,815円	503,777,093円
3 計算期間末日における受益権の総数	2,233,788,259口	2,893,780,118口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9171円 (9,171円)	0.8259円 (8,259円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期(自平成21年1月20日 至平成22年1月18日)

## 1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	57,801,526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	23,016,082円
分配準備積立金額	D	17,271,855円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	98,089,463円
当ファンドの期末残存口数	F	2,233,788,259口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	439円
1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	2,233,788円

## 第3期（自平成22年1月19日 至 平成23年1月17日）

## 1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	67,022,223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	63,505,171円
分配準備積立金額	D	61,621,606円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	192,149,000円
当ファンドの期末残存口数	F	2,893,780,118口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	664円
1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	2,893,780円

## （金融商品に関する注記）

## 1 金融商品の状況に関する事項

区分	第3期 （自平成22年1月19日 至平成23年1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。
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を実質的な主要投資対象としております。投資する親投資信託受益証券の詳細は「（4）附属明細表」に記載しております。親投資信託受益証券は、価格変動リスク、為替変動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、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。
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。

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第3期 [平成23年1月17日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているためその差額はありません。
2 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 （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。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 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。
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。

## （有価証券関係に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第2期 [平成22年1月18日現在]		第3期 [平成23年1月17日現在]
	貸借対照表計上額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	2,048,409,931	99,409,274	210,268,067
合計	2,048,409,931	99,409,274	210,268,067

## （デリバティブ取引等関係に関する注記）

## 第2期（自平成21年1月20日 至 平成22年1月18日）

## 1 取引の状況に関する事項

該当事項はありません。

## 2 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## 第3期 [平成23年1月17日現在]

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。



(関連当事者との取引に関する注記)  
該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式  
該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	口数(口)	評価額	備考
親投資信託受益証券	三菱UFJ 外国債券マザーファンド	1,431,368,726	2,389,956,361	
	親投資信託受益証券 小計	1,431,368,726	2,389,956,361	
	合計	1,431,368,726	2,389,956,361	

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「三菱UFJ」外国債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された

「親投資信託受益証券」は、同親投資信託の受益証券です。

なお、同親投資信託の状況は次の通りです。

「三菱UFJ」外国債券マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

## (1) 貸借対照表

	[ 平成22年1月18日現在 ]	[ 平成23年1月17日現在 ]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	540,104,600	209,555,510
コール・ローン	46,108,544	30,423,234
国債証券	229,594,894,033	214,802,089,979
派生商品評価勘定	1,192,975	42,947
未収入金	44,088,204	135,619,850
未収利息	3,136,281,701	2,625,731,526
前払費用	143,152,216	148,833,474
流動資産合計	233,505,822,273	217,952,296,520
資産合計	233,505,822,273	217,952,296,520
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	180	616,295
未払解約金	96,836,778	149,525,004
流動負債合計	96,836,958	150,141,299
負債合計	96,836,958	150,141,299
純資産の部		
元本等		
元本	1 126,845,869,091	130,446,209,621
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	106,563,116,224	87,355,945,600
元本等合計	233,408,985,315	217,802,155,221
純資産合計	233,408,985,315	217,802,155,221
負債純資産合計	233,505,822,273	217,952,296,520

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

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	( 自 平成21年 1月20日 至 平成22年 1月18日 )	( 自 平成22年 1月19日 至 平成23年 1月17日 )
1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>同 左</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同 左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同 左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同 左</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算期間末日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>	<p>為替予約取引 同 左</p>
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>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。</p>	<p>外貨建資産等の会計処理 同 左</p>

(貸借対照表に関する注記)

	[平成22年1月18日現在]	[平成23年1月17日現在]
1 期首		
期首元本額	平成21年1月20日 132,050,450,357円	平成22年1月19日 126,845,869,091円
期首からの追加設定元本額	12,834,635,310円	12,977,247,143円
期首からの一部解約元本額	18,039,216,576円	9,376,906,613円
元本の内訳*		
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	110,289,493円	136,894,762円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	163,638,643円	209,238,314円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	99,410,815円	126,158,974円
三菱UFJ 外国債券オープン	4,134,909,496円	4,044,708,577円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	483,357,552円	651,956,821円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	1,330,283,107円	1,738,292,252円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	780,893,530円	1,026,267,087円
三菱UFJ 財産分散ファンド(毎月決算型)	3,175,433,303円	2,944,298,033円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	2,042,896,323円	1,984,818,663円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	221,900,182円	240,350,176円
FPバランスファンド(安定型)	68,418,315円	69,487,575円
FPバランスファンド(安定成長型)	115,147,320円	137,357,991円
三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金)	1,546,103,892円	1,710,157,691円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型)	961,126,282円	936,025,663円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)	1,113,205,767円	1,431,368,726円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	108,919,210,236円	109,121,696,042円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)VA(適格機関投資家限定)	4,577,266円	4,745,777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)	15,621,118円	16,058,106円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2(適格機関投資家限定)	471,661,819円	418,162,157円
MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)		3,304,175,606円
ワールドバランス2006	151,189,469円	150,947,754円
MUAM 世界国債インデックスファンド2007-12(適格機関投資家限定)	936,595,163円	43,042,874円
(合計)	126,845,869,091円	130,446,209,621円
2 計算期間末日における受益権の総数	126,845,869,091口	130,446,209,621口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8401円 (18,401円)	1.6697円 (16,697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22年1月19日 至平成23年1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。
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、公社債を実質的な主要投資対象としております。公社債の投資に係る価格変動リスク、為替変動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。
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。

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成23年1月17日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているためその差額はありません。
2 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 (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。 (2) デリバティブ取引 (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。 (3) 上記以外の金融商品 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。

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。

(有価証券関係に関する注記)  
売買目的有価証券

種 類	[ 平成22年1月18日現在 ]		[ 平成23年1月17日現在 ]
	貸借対照表計上額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	229,594,894,033	143,850,982	4,120,649,947
合計	229,594,894,033	143,850,982	4,120,649,947

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

## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

## 1 取引の状況に関する事項

区 分	( 自 平成21年 1月20日 至 平成22年 1月18日 )
1 取引の内容、取引の利用目的及び取引に対する取組方針	当ファンドは、外貨の決済のために、その受渡までの期間がごく短い為替予約取引を利用しております。
2 取引に係るリスクの内容	外貨の決済のために行う為替予約取引は、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。
3 取引に係るリスクの管理体制	運用部門において、資産構成比率に関する事項や、その他ファンドのリスク特性に関する事項を主な対象項目として常時把握し、ファンドコンセプトに沿ったリスクの範囲でコントロールしています。 また、運用部門から独立した管理部門によってリスク運営状況等をモニタリングする体制をとっており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。
4 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## 2 取引の時価等に関する事項

## 通貨関連

区 分	種 類	[ 平成22年1月18日現在 ]		
		契 約 額 等 (円)	時 価	評 価 損 益
		うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建			
	アメリカドル	39,246,375	39,035,400	210,975
	カナダドル	2,667,900	2,641,500	26,400
	イギリスポンド	7,437,010	7,382,500	54,510
	シンガポールドル	657,400	652,300	5,100
	ユーロ	50,364,210	49,468,400	895,810
	合 計	100,372,895	99,180,100	1,192,795

## (注) 時価の算定方法

1 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

計算期間末日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

(イ) 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

2 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

[ 平成23年1月17日現在 ]

## 取引の時価等に関する事項

## 通貨関連

区 分	種 類	[ 平成23年1月17日現在 ]		
		契 約 額 等 (円)	時 価	評 価 損 益
		うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建			
	アメリカドル	66,304,543	66,352,000	47,457
	カナダドル	5,031,084	5,034,600	3,516
	オーストラリアドル	2,305,647	2,297,250	8,397
	イギリスポンド	15,730,017	15,790,800	60,783
	シンガポールドル	837,187	837,200	13
	スウェーデンクローネ	1,232,750	1,241,000	8,250
	ノルウェークローネ	843,780	850,200	6,420
	デンマーククローネ	1,482,270	1,487,000	4,730
	メキシコペソ	1,571,429	1,582,400	10,971
	ポーランドズロチ	1,994,657	2,003,400	8,743
	ユーロ	67,175,438	67,606,300	430,862
	合 計	164,508,802	165,082,150	573,348

## (注) 時価の算定方法

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

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

[次へ](#)

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

通貨		券面総額	評価額	備考
種類	銘柄			
アメリカドル				
国債証券	0.375 T-NOTE 120831	6,000,000.00	5,988,750.00	
	0.375 T-NOTE 120930	5,400,000.00	5,386,921.89	
	0.375 T-NOTE 121031	6,400,000.00	6,380,000.00	
	0.5 T-NOTE 121130	6,600,000.00	6,592,265.64	
	0.5 T-NOTE 131015	6,000,000.00	5,938,593.78	
	0.5 T-NOTE 131115	5,500,000.00	5,435,117.21	
	0.625 T-NOTE 120630	7,500,000.00	7,520,507.85	
	0.625 T-NOTE 120731	6,200,000.00	6,215,500.00	
	0.75 T-NOTE 120531	6,600,000.00	6,630,421.90	
	0.75 T-NOTE 130815	6,500,000.00	6,490,859.37	
	0.75 T-NOTE 130915	6,500,000.00	6,484,257.83	
	0.75 T-NOTE 131215	6,000,000.00	5,963,437.50	
	0.875 T-NOTE 120131	6,500,000.00	6,535,546.87	
	0.875 T-NOTE 120229	5,000,000.00	5,027,929.70	
	1 T-NOTE 111231	3,100,000.00	3,120,222.66	
	1 T-NOTE 120331	6,800,000.00	6,850,468.78	
	1 T-NOTE 120430	6,900,000.00	6,954,445.34	
	1 T-NOTE 130715	7,000,000.00	7,038,281.25	
	1.125 T-NOTE 120115	8,200,000.00	8,262,781.25	
	1.125 T-NOTE 121215	7,900,000.00	7,978,382.85	
	1.125 T-NOTE 130615	7,500,000.00	7,566,210.97	
	1.25 T-NOTE 150831	6,300,000.00	6,149,882.84	
	1.25 T-NOTE 150930	6,500,000.00	6,332,421.87	
	1.25 T-NOTE 151031	6,800,000.00	6,608,218.78	
	1.375 T-NOTE 120215	6,700,000.00	6,773,019.54	
	1.375 T-NOTE 120315	5,800,000.00	5,868,195.29	
	1.375 T-NOTE 120415	6,100,000.00	6,175,296.87	
	1.375 T-NOTE 120515	8,600,000.00	8,710,859.41	
	1.375 T-NOTE 120915	8,000,000.00	8,113,750.00	
	1.375 T-NOTE 121015	8,900,000.00	9,028,632.85	
	1.375 T-NOTE 121115	8,500,000.00	8,624,843.75	
	1.375 T-NOTE 130115	8,500,000.00	8,626,835.98	
	1.375 T-NOTE 130215	8,200,000.00	8,322,359.41	
	1.375 T-NOTE 130315	8,000,000.00	8,120,625.04	
	1.375 T-NOTE 130515	7,400,000.00	7,512,156.25	
	1.375 T-NOTE 151130	6,000,000.00	5,854,218.78	
	1.5 T-NOTE 120715	8,500,000.00	8,635,468.75	
	1.5 T-NOTE 131231	5,700,000.00	5,788,617.21	
	1.75 T-NOTE 120815	9,000,000.00	9,182,812.50	
	1.75 T-NOTE 130415	7,900,000.00	8,085,156.25	
	1.75 T-NOTE 140131	5,500,000.00	5,622,890.62	
	1.75 T-NOTE 140331	7,000,000.00	7,150,390.66	
	1.75 T-NOTE 150731	5,700,000.00	5,701,781.25	
	1.875 T-NOTE 120615	7,000,000.00	7,142,187.50	
	1.875 T-NOTE 140228	4,900,000.00	5,025,562.50	
	1.875 T-NOTE 140430	6,500,000.00	6,664,023.47	
	1.875 T-NOTE 150630	8,000,000.00	8,060,000.00	
	1.875 T-NOTE 170831	3,500,000.00	3,352,890.62	
	1.875 T-NOTE 170930	2,900,000.00	2,771,765.62	
	1.875 T-NOTE 171031	5,100,000.00	4,864,921.87	
	2 T-NOTE 131130	5,300,000.00	5,459,828.12	
	2.125 T-NOTE 141130	4,400,000.00	4,522,031.27	
	2.125 T-NOTE 150531	7,900,000.00	8,053,062.50	
	2.25 T-NOTE 140531	8,000,000.00	8,294,375.04	
	2.25 T-NOTE 150131	5,800,000.00	5,976,718.75	
	2.25 T-NOTE 171130	2,300,000.00	2,244,296.87	
	2.375 T-NOTE 140831	8,300,000.00	8,624,867.22	
	2.375 T-NOTE 140930	9,200,000.00	9,559,375.00	

2.375 T-NOTE 141031	9,000,000.00	9,342,421.92
2.375 T-NOTE 150228	7,200,000.00	7,444,687.53
2.375 T-NOTE 160331	4,400,000.00	4,474,250.00
2.375 T-NOTE 170731	2,900,000.00	2,873,265.62
2.5 T-NOTE 130331	3,800,000.00	3,954,375.00
2.5 T-NOTE 150331	7,700,000.00	7,995,367.22
2.5 T-NOTE 150430	8,300,000.00	8,607,359.37
2.5 T-NOTE 170630	5,100,000.00	5,096,812.50
2.625 T-NOTE 140630	9,400,000.00	9,861,187.50
2.625 T-NOTE 140731	5,500,000.00	5,768,554.71
2.625 T-NOTE 141231	7,700,000.00	8,052,515.62
2.625 T-NOTE 160229	3,700,000.00	3,812,734.37
2.625 T-NOTE 160430	3,800,000.00	3,904,500.00
2.625 T-NOTE 200815	11,300,000.00	10,685,562.50
2.625 T-NOTE 201115	6,600,000.00	6,209,156.24
2.75 T-NOTE 130228	3,300,000.00	3,446,437.50
2.75 T-NOTE 131031	4,700,000.00	4,940,875.00
2.75 T-NOTE 161130	6,200,000.00	6,352,093.75
2.75 T-NOTE 170531	6,000,000.00	6,100,312.50
2.75 T-NOTE 190215	12,400,000.00	12,229,500.00
2.875 T-NOTE 130131	3,200,000.00	3,348,000.00
3 T-NOTE 160831	5,500,000.00	5,728,593.75
3 T-NOTE 160930	6,100,000.00	6,344,000.00
3 T-NOTE 170228	6,500,000.00	6,727,500.00
3.125 T-NOTE 130430	4,000,000.00	4,225,000.00
3.125 T-NOTE 130831	4,500,000.00	4,777,382.83
3.125 T-NOTE 130930	5,000,000.00	5,307,421.90
3.125 T-NOTE 161031	7,000,000.00	7,323,750.00
3.125 T-NOTE 170131	6,500,000.00	6,779,296.87
3.125 T-NOTE 170430	5,900,000.00	6,135,078.12
3.125 T-NOTE 190515	15,300,000.00	15,448,218.75
3.25 T-NOTE 160531	4,200,000.00	4,445,437.50
3.25 T-NOTE 160630	4,400,000.00	4,653,687.50
3.25 T-NOTE 160731	5,500,000.00	5,810,234.37
3.25 T-NOTE 161231	6,400,000.00	6,727,000.00
3.25 T-NOTE 170331	6,600,000.00	6,916,593.75
3.375 T-NOTE 121130	3,000,000.00	3,159,843.75
3.375 T-NOTE 130630	4,400,000.00	4,683,937.50
3.375 T-NOTE 130731	4,100,000.00	4,371,625.00
3.375 T-NOTE 191115	14,200,000.00	14,477,343.75
3.5 T-BOND 390215	5,700,000.00	4,763,953.12
3.5 T-NOTE 130531	3,900,000.00	4,157,156.25
3.5 T-NOTE 180215	6,600,000.00	6,959,906.25
3.5 T-NOTE 200515	11,000,000.00	11,238,906.25
3.625 T-NOTE 121231	3,100,000.00	3,284,546.87
3.625 T-NOTE 130515	3,300,000.00	3,526,875.00
3.625 T-NOTE 190815	13,800,000.00	14,395,125.00
3.625 T-NOTE 200215	12,600,000.00	13,054,781.25
3.75 T-NOTE 181115	11,400,000.00	12,114,281.25
3.875 T-BOND 400815	8,400,000.00	7,497,000.00
3.875 T-NOTE 121031	3,000,000.00	3,180,703.14
3.875 T-NOTE 130215	3,800,000.00	4,055,906.25
3.875 T-NOTE 180515	5,000,000.00	5,389,062.50
4 T-NOTE 121115	4,200,000.00	4,469,062.50
4 T-NOTE 140215	5,500,000.00	6,001,015.62
4 T-NOTE 150215	7,600,000.00	8,344,562.50
4 T-NOTE 180815	6,200,000.00	6,716,343.75
4.125 T-NOTE 120831	3,000,000.00	3,178,359.39
4.125 T-NOTE 150515	5,400,000.00	5,967,843.75
4.25 T-BOND 390515	8,100,000.00	7,743,093.75
4.25 T-BOND 401115	6,000,000.00	5,723,437.50
4.25 T-NOTE 120930	3,200,000.00	3,403,250.01
4.25 T-NOTE 130815	6,300,000.00	6,859,125.00
4.25 T-NOTE 131115	5,800,000.00	6,348,281.25
4.25 T-NOTE 140815	6,000,000.00	6,637,500.00
4.25 T-NOTE 141115	6,100,000.00	6,758,609.37
4.25 T-NOTE 150815	5,500,000.00	6,113,593.75
4.25 T-NOTE 171115	4,600,000.00	5,081,562.50
4.375 T-BOND 380215	3,300,000.00	3,237,609.37



4.375 T-BOND 391115	8,500,000.00	8,294,140.62	
4.375 T-BOND 400515	7,700,000.00	7,506,296.87	
4.375 T-NOTE 120815	4,400,000.00	4,672,937.50	
4.5 T-BOND 360215	5,000,000.00	5,035,937.50	
4.5 T-BOND 380515	4,300,000.00	4,302,687.50	
4.5 T-BOND 390815	8,900,000.00	8,870,796.87	
4.5 T-NOTE 120331	3,700,000.00	3,883,554.70	
4.5 T-NOTE 120430	3,700,000.00	3,896,273.45	
4.5 T-NOTE 151115	4,500,000.00	5,056,171.87	
4.5 T-NOTE 160215	4,300,000.00	4,831,453.12	
4.5 T-NOTE 170515	3,800,000.00	4,263,125.00	
4.625 T-BOND 400215	8,500,000.00	8,647,421.87	
4.625 T-NOTE 111231	4,000,000.00	4,162,187.52	
4.625 T-NOTE 120229	2,500,000.00	2,619,238.27	
4.625 T-NOTE 120731	2,500,000.00	2,660,546.87	
4.625 T-NOTE 161115	4,800,000.00	5,425,500.00	
4.625 T-NOTE 170215	4,100,000.00	4,631,078.12	
4.75 T-BOND 370215	3,000,000.00	3,135,937.50	
4.75 T-NOTE 120131	3,000,000.00	3,137,812.50	
4.75 T-NOTE 120531	3,200,000.00	3,391,500.00	
4.75 T-NOTE 140515	7,300,000.00	8,169,156.25	
4.75 T-NOTE 170815	3,900,000.00	4,435,031.25	
4.875 T-NOTE 120215	6,500,000.00	6,818,906.25	
4.875 T-NOTE 120630	2,900,000.00	3,088,726.57	
4.875 T-NOTE 160815	3,700,000.00	4,228,984.37	
5 T-BOND 370515	3,000,000.00	3,253,593.75	
5.125 T-NOTE 160515	3,700,000.00	4,275,234.37	
5.25 T-BOND 281115	2,000,000.00	2,256,875.00	
5.25 T-BOND 290215	1,900,000.00	2,144,328.12	
5.375 T-BOND 310215	3,000,000.00	3,436,406.25	
5.5 T-BOND 280815	1,900,000.00	2,205,929.69	
6 T-BOND 260215	2,400,000.00	2,933,812.51	
6.125 T-BOND 271115	3,400,000.00	4,213,343.75	
6.125 T-BOND 290815	1,800,000.00	2,240,578.13	
6.25 T-BOND 230815	3,800,000.00	4,744,656.25	
6.25 T-BOND 300515	3,000,000.00	3,790,781.25	
6.375 T-BOND 270815	1,200,000.00	1,524,375.00	
6.5 T-BOND 261115	1,500,000.00	1,924,453.12	
6.625 T-BOND 270215	1,300,000.00	1,688,984.37	
6.75 T-BOND 260815	1,200,000.00	1,575,000.00	
6.875 T-BOND 250815	1,900,000.00	2,513,640.62	
7.125 T-BOND 230215	2,100,000.00	2,805,468.75	
7.25 T-BOND 160515	3,000,000.00	3,794,531.25	
7.25 T-BOND 220815	1,600,000.00	2,156,625.00	
7.5 T-BOND 161115	3,100,000.00	3,995,609.37	
7.5 T-BOND 241115	1,700,000.00	2,360,343.75	
7.625 T-BOND 250215	1,600,000.00	2,247,500.00	
7.875 T-BOND 210215	1,700,000.00	2,367,781.25	
8 T-BOND 211115	4,300,000.00	6,066,359.37	
8.125 T-BOND 190815	3,200,000.00	4,454,000.00	
8.125 T-BOND 210515	1,300,000.00	1,841,531.25	
8.125 T-BOND 210815	1,300,000.00	1,847,421.87	
8.75 T-BOND 170515	2,300,000.00	3,162,859.37	
8.75 T-BOND 200815	2,500,000.00	3,648,437.50	
8.875 T-BOND 170815	1,500,000.00	2,088,515.62	
8.875 T-BOND 190215	2,200,000.00	3,163,187.50	
国債証券 小計	1,001,600,000.00	1,046,596,176.59 (86,815,152,848)	
アメリカドル 小計	1,001,600,000.00	1,046,596,176.59 (86,815,152,848)	
カナダドル			
国債証券			
1.5 CAN GOVT 120301	1,700,000.00	1,699,813.00	
1.5 CAN GOVT 120601	1,600,000.00	1,597,616.00	
1.5 CAN GOVT 121201	2,400,000.00	2,387,040.00	
1.75 CAN GOVT 130301	1,600,000.00	1,596,256.00	
2 CAN GOVT 120901	3,500,000.00	3,516,800.00	
2 CAN GOVT 141201	3,100,000.00	3,060,537.00	
2 CAN GOVT 160601	400,000.00	386,152.00	
2.5 CAN GOVT 130901	1,200,000.00	1,215,120.00	
2.5 CAN GOVT 150601	1,100,000.00	1,102,101.00	

3 CAN GOVT 140601	3,800,000.00	3,894,392.00	
3 CAN GOVT 151201	2,000,000.00	2,038,400.00	
3.25 CAN GOVT 210601	1,300,000.00	1,285,856.00	
3.5 CAN GOVT 130601	3,800,000.00	3,937,598.00	
3.5 CAN GOVT 200601	2,500,000.00	2,545,000.00	
3.75 CAN GOVT 120601	2,100,000.00	2,160,774.00	
3.75 CAN GOVT 190601	4,000,000.00	4,171,200.00	
4 CAN GOVT 160601	2,700,000.00	2,877,471.00	
4 CAN GOVT 170601	2,300,000.00	2,452,490.00	
4 CAN GOVT 410601	3,300,000.00	3,488,100.00	
4.25 CAN GOVT 180601	2,400,000.00	2,593,896.00	
4.5 CAN GOVT 150601	2,900,000.00	3,146,123.00	
5 CAN GOVT 140601	2,500,000.00	2,724,950.00	
5 CAN GOVT 370601	3,000,000.00	3,632,220.00	
5.25 CAN GOVT 120601	2,750,000.00	2,885,437.50	
5.25 CAN GOVT 130601	2,200,000.00	2,368,872.00	
5.75 CAN GOVT 290601	2,700,000.00	3,449,520.00	
5.75 CAN GOVT 330601	2,800,000.00	3,656,128.00	
8 CAN GOVT 230601	900,000.00	1,306,251.00	
8 CAN GOVT 270601	1,400,000.00	2,153,900.00	
9 CAN GOVT 250601	700,000.00	1,127,763.00	
国債証券 小計	68,650,000.00	74,457,776.50 (6,248,496,603)	
カナダドル 小計	68,650,000.00	74,457,776.50 (6,248,496,603)	
オーストラリアドル			
国債証券			
4.5 AUST GOVT 141021	700,000.00	683,635.40	
4.5 AUST GOVT 200415	2,500,000.00	2,322,240.00	
4.75 AUST GOVT 121115	1,500,000.00	1,494,063.00	
4.75 AUST GOVT 160615	1,300,000.00	1,266,079.10	
5.25 AUST GOVT 190315	2,700,000.00	2,663,728.20	
5.5 AUST GOVT 131215	1,400,000.00	1,413,020.00	
5.5 AUST GOVT 180121	300,000.00	301,295.40	
5.75 AUST GOVT 120415	3,100,000.00	3,133,790.00	
5.75 AUST GOVT 210515	2,200,000.00	2,240,101.60	
5.75 AUST GOVT 220715	1,100,000.00	1,118,920.00	
6 AUST GOVT 170215	2,900,000.00	2,997,361.70	
6.25 AUST GOVT 140615	2,400,000.00	2,483,796.00	
6.25 AUST GOVT 150415	2,900,000.00	3,014,912.50	
6.5 AUST GOVT 130515	3,380,000.00	3,490,225.18	
国債証券 小計	28,380,000.00	28,623,168.08 (2,349,103,404)	
オーストラリアドル 小計	28,380,000.00	28,623,168.08 (2,349,103,404)	
イギリスポンド			
国債証券			
2 GILT 160122	1,700,000.00	1,648,371.00	
2.25 GILT 140307	5,500,000.00	5,578,760.00	
2.75 GILT 150122	5,800,000.00	5,907,880.00	
3.75 GILT 190907	5,300,000.00	5,385,542.00	
3.75 GILT 200907	3,400,000.00	3,412,818.00	
4 GILT 160907	4,800,000.00	5,106,000.00	
4 GILT 220307	2,800,000.00	2,837,436.00	
4 GILT 600122	2,100,000.00	1,957,242.00	
4.25 GILT 271207	3,300,000.00	3,315,081.00	
4.25 GILT 320607	3,600,000.00	3,544,020.00	
4.25 GILT 360307	4,000,000.00	3,896,240.00	
4.25 GILT 390907	2,800,000.00	2,731,680.00	
4.25 GILT 401207	2,700,000.00	2,615,895.00	
4.25 GILT 461207	3,800,000.00	3,687,520.00	
4.25 GILT 491207	3,500,000.00	3,424,960.00	
4.25 GILT 551207	3,400,000.00	3,345,056.00	
4.5 GILT 130307	5,800,000.00	6,186,860.00	
4.5 GILT 190307	4,400,000.00	4,729,296.00	
4.5 GILT 340907	3,000,000.00	3,026,400.00	
4.5 GILT 421207	3,700,000.00	3,759,237.00	
4.75 GILT 150907	4,300,000.00	4,733,010.00	
4.75 GILT 200307	4,300,000.00	4,679,260.00	
4.75 GILT 301207	3,400,000.00	3,587,680.00	
4.75 GILT 381207	3,800,000.00	4,017,474.00	
5 GILT 120307	5,600,000.00	5,855,920.00	

	5 GILT 140907	4,400,000.00	4,855,400.00	
	5 GILT 180307	2,700,000.00	3,015,522.00	
	5 GILT 250307	3,300,000.00	3,632,838.00	
	5.25 GILT 120607	5,250,000.00	5,555,025.00	
	6 GILT 281207	2,500,000.00	3,057,825.00	
	8 GILT 130927	1,600,000.00	1,878,720.00	
	8 GILT 151207	1,300,000.00	1,630,850.00	
	8 GILT 210607	2,500,000.00	3,425,000.00	
	8.75 GILT 170825	1,600,000.00	2,163,680.00	
	国債証券 小計	121,950,000.00	128,184,498.00 (16,869,079,936)	
	イギリスポンド 小計	121,950,000.00	128,184,498.00 (16,869,079,936)	
	スイスフラン			
国債証券	2.5 SWISS GOVT 160312	1,450,000.00	1,547,875.00	
	2.75 SWISS GOVT 120610	1,800,000.00	1,855,980.00	
	3 SWISS GOVT 180108	1,400,000.00	1,542,660.00	
	3 SWISS GOVT 190512	1,160,000.00	1,284,816.00	
	4 SWISS GOVT 130211	1,500,000.00	1,606,950.00	
	4 SWISS GOVT 230211	1,000,000.00	1,219,200.00	
	4 SWISS GOVT 280408	1,200,000.00	1,531,680.00	
	4.25 SWISS GOVT 140106	1,000,000.00	1,102,400.00	
	4.25 SWISS GOVT 170605	1,200,000.00	1,408,800.00	
	国債証券 小計	11,710,000.00	13,100,361.00 (1,126,762,049)	
	スイスフラン 小計	11,710,000.00	13,100,361.00 (1,126,762,049)	
	シンガポールドル			
国債証券	1.375SINGAPORGOVT 141001	300,000.00	306,161.40	
	1.625SINGAPORGOVT 130401	500,000.00	511,371.00	
	2.25 SINGAPORGOVT 130701	800,000.00	836,557.60	
	2.375 SINGAPORGOVT 170401	400,000.00	412,908.00	
	2.5 SINGAPORGOVT 121001	900,000.00	930,168.90	
	2.5 SINGAPORGOVT 190601	300,000.00	301,992.90	
	2.625SINGAPORGOVT 120401	800,000.00	820,841.60	
	2.875SINGAPORGOVT 150701	800,000.00	855,984.80	
	2.875SINGAPORGOVT 300901	300,000.00	282,185.10	
	3 SINGAPORGOVT 240901	400,000.00	401,123.20	
	3.125SINGAPORGOVT 220901	700,000.00	726,049.80	
	3.25 SINGAPORGOVT 200901	1,000,000.00	1,059,068.00	
	3.5 SINGAPORGOVT 120701	800,000.00	839,244.00	
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	900,000.00	932,715.90	
	3.625SINGAPORGOVT 140701	1,300,000.00	1,440,624.90	
	3.75 SINGAPORGOVT 160901	1,100,000.00	1,223,172.50	
	4 SINGAPORGOVT 180901	900,000.00	1,011,949.20	
	国債証券 小計	12,200,000.00	12,892,118.80 (830,381,371)	
	シンガポールドル 小計	12,200,000.00	12,892,118.80 (830,381,371)	

[次へ](#)

（単位：円）

通貨種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
マレーシアリングット				
国債証券	2.509MALAYSIAGOVT 120827	2,300,000.00	2,282,991.50	
	3.21 MALAYSIAGOVT 130531	700,000.00	700,910.00	
	3.502MALAYSIAGOVT 270531	3,000,000.00	2,723,178.00	
	3.718MALAYSIAGOVT 120615	10,800,000.00	10,916,704.80	
	3.741 MALAYSIAGOV 150227	2,500,000.00	2,533,112.50	
	3.814MALAYSIAGOVT 170215	1,600,000.00	1,617,609.60	
	3.835MALAYSIAGOVT 150812	800,000.00	812,500.00	
	4.012 MALAYSIAGOV 170915	500,000.00	508,811.50	
	4.262MALAYSIAGOVT 160915	8,800,000.00	9,107,938.40	
	4.378MALAYSIAGOVT 191129	4,000,000.00	4,112,188.00	
	5.094MALAYSIAGOVT 140430	5,500,000.00	5,805,217.00	
	5.734MALAYSIAGOVT 190730	2,000,000.00	2,255,890.00	
	国債証券 小計		42,500,000.00	43,377,051.30 (1,177,253,172)
マレーシアリングット 小計		42,500,000.00	43,377,051.30 (1,177,253,172)	
スウェーデンクローネ				
国債証券	3 SWD GOVT 160712	9,300,000.00	9,331,062.00	
	3.5 SWD GOVT 390330	9,000,000.00	8,574,030.00	
	3.75 SWD GOVT 170812	10,600,000.00	11,039,052.00	
	4.25 SWD GOVT 190312	17,600,000.00	18,974,736.00	
	4.5 SWD GOVT 150812	13,200,000.00	14,165,712.00	
	5 SWD GOVT 201201	18,500,000.00	21,256,315.00	
	5.5 SWD GOVT 121008	13,500,000.00	14,322,150.00	
	6.75 SWD GOVT 140505	17,100,000.00	19,356,003.00	
国債証券 小計		108,800,000.00	117,019,060.00 (1,453,376,725)	
スウェーデンクローネ 小計		108,800,000.00	117,019,060.00 (1,453,376,725)	
ノルウェークローネ				
国債証券	4.25 NORWE GOVT 170519	7,900,000.00	8,279,200.00	
	4.5 NORWE GOVT 190522	5,600,000.00	5,932,640.00	
	5 NORWE GOVT 150515	10,900,000.00	11,751,290.00	
	6.5 NORWE GOVT 130515	12,800,000.00	13,927,680.00	
国債証券 小計		37,200,000.00	39,890,810.00 (565,651,685)	
ノルウェークローネ 小計		37,200,000.00	39,890,810.00 (565,651,685)	
デンマーククローネ				
国債証券	4 DMK GOVT 121115	15,800,000.00	16,595,530.00	
	4 DMK GOVT 151115	18,400,000.00	19,870,160.00	
	4 DMK GOVT 171115	12,200,000.00	13,193,080.00	
	4 DMK GOVT 191115	18,600,000.00	19,959,660.00	
	4.5 DMK GOVT 391115	21,100,000.00	25,056,250.00	
	5 DMK GOVT 131115	18,500,000.00	20,303,750.00	
	7 DMK GOVT 241110	5,500,000.00	7,660,400.00	
国債証券 小計		110,100,000.00	122,638,830.00 (1,824,865,790)	
デンマーククローネ 小計		110,100,000.00	122,638,830.00 (1,824,865,790)	
メキシコペソ				
国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	17,600,000.00	21,637,440.00	
	10 MEXICAN BONOS 361120	13,100,000.00	15,843,140.00	
	6 MEXICAN BONOS 150618	10,200,000.00	10,130,374.80	
	7 MEXICAN BONOS 140619	7,800,000.00	8,112,413.40	
	7.25 MEXICAN BONO 161215	11,700,000.00	12,111,840.00	
	7.5 MEXICAN BONOS 120621	23,600,000.00	24,503,880.00	
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	19,000,000.00	18,682,700.00	
	7.75 MEXICAN BONO 171214	14,900,000.00	15,773,140.00	
	8 MEXICAN BONOS 131219	17,400,000.00	18,535,280.40	
	8 MEXICAN BONOS 151217	9,100,000.00	9,690,135.00	
	8 MEXICAN BONOS 200611	19,400,000.00	20,703,680.00	
	8 MEXICAN BONOS 231207	5,700,000.00	6,028,320.00	
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	9,000,000.00	9,929,745.00	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	14,300,000.00	15,207,792.60	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	11,000,000.00	11,452,056.00	

	9 MEXICAN BONOS 121220	20,800,000.00	22,239,360.00	
	9 MEXICAN BONOS 130620	18,900,000.00	20,390,265.00	
	9.5 MEXICAN BONOS 141218	21,000,000.00	23,473,464.00	
	国債証券 小計	264,500,000.00	284,445,026.20 (1,959,826,230)	
	メキシコペソ 小計	264,500,000.00	284,445,026.20 (1,959,826,230)	
	ポーランドズロチ			
国債証券	4.75 POLAND 120425	6,800,000.00	6,806,800.00	
	5 POLAND 131024	6,300,000.00	6,269,130.00	
	5.25 POLAND 130425	5,100,000.00	5,118,360.00	
	5.25 POLAND 171025	6,800,000.00	6,562,000.00	
	5.25 POLAND 201025	3,300,000.00	3,055,470.00	
	5.5 POLAND 150425	4,700,000.00	4,681,200.00	
	5.5 POLAND 191025	4,600,000.00	4,371,840.00	
	5.75 POLAND 140425	6,500,000.00	6,558,500.00	
	5.75 POLAND 220923	6,100,000.00	5,804,150.00	
	5.75 POLAND 290425	1,400,000.00	1,303,400.00	
	6.25 POLAND 151024	6,300,000.00	6,443,640.00	
	POLAND 120125	5,400,000.00	5,157,540.00	
	POLAND 120725	5,600,000.00	5,209,680.00	
	POLAND 121025	4,600,000.00	4,245,800.00	
	国債証券 小計	73,500,000.00	71,587,510.00 (2,049,550,411)	
	ポーランドズロチ 小計	73,500,000.00	71,587,510.00 (2,049,550,411)	
	ユーロ			
国債証券	0.5 SCHATS 120615	3,700,000.00	3,675,543.00	
	0.75 BTAN 120920	3,300,000.00	3,277,890.00	
	0.75 SCHATS 120914	4,100,000.00	4,079,541.00	
	1 SCHATS 120316	3,700,000.00	3,705,661.00	
	1 SCHATS 121214	2,200,000.00	2,193,752.00	
	1.75 FINNISH GOVT 160415	600,000.00	582,720.00	
	1.75 NETH GOVT 130115	3,200,000.00	3,233,280.00	
	1.75 OBL 151009	3,400,000.00	3,355,766.00	
	2 BEL GOVT 120328	1,500,000.00	1,507,350.00	
	2 BTAN 150712	4,500,000.00	4,444,200.00	
	2 ITALY GOVT 121215	4,100,000.00	4,055,720.00	
	2 ITALY GOVT 130601	3,700,000.00	3,624,150.00	
	2.25 BUND 200904	3,500,000.00	3,291,400.00	
	2.25 ITALY GOVT 131101	1,600,000.00	1,564,640.00	
	2.25 OBL 140411	4,600,000.00	4,710,722.00	
	2.25 OBL 150410	2,200,000.00	2,232,340.00	
	2.3 SPAIN GOVT 130430	2,800,000.00	2,724,680.00	
	2.5 BTAN 140112	4,700,000.00	4,817,030.00	
	2.5 BTAN 150115	4,400,000.00	4,469,080.00	
	2.5 BUND 210104	1,200,000.00	1,146,120.00	
	2.5 ITALY GOVT 120701	3,700,000.00	3,707,770.00	
	2.5 NETH GOVT 120115	3,100,000.00	3,148,360.00	
	2.5 O.A.T 201025	2,200,000.00	2,036,540.00	
	2.5 OBL 141010	3,400,000.00	3,499,212.00	
	2.5 OBL 150227	3,500,000.00	3,590,090.00	
	2.5 SPAIN GOVT 131031	3,000,000.00	2,901,900.00	
	2.75 BEL GOVT 160328	1,700,000.00	1,641,010.00	
	2.75 NETH GOVT 150115	2,800,000.00	2,880,640.00	
	2.75 SPAIN GOVT 120430	2,600,000.00	2,590,900.00	
	3 BTAN 140712	4,500,000.00	4,672,800.00	
	3 BUND 200704	4,600,000.00	4,597,148.00	
	3 ITALY GOVT 120301	3,300,000.00	3,331,284.00	
	3 ITALY GOVT 150415	4,500,000.00	4,411,800.00	
	3 ITALY GOVT 150615	3,300,000.00	3,221,460.00	
	3 ITALY GOVT 151101	1,000,000.00	969,800.00	
	3 O.A.T 151025	6,200,000.00	6,374,840.00	
	3 SPAIN GOVT 150430	2,700,000.00	2,566,890.00	
	3.125 FINNISHGOVT 140915	1,400,000.00	1,468,180.00	
	3.15 SPAIN GOVT 160131	3,200,000.00	3,012,160.00	
	3.2 AUSTRIA GOVT 170220	1,100,000.00	1,123,320.00	
	3.25 BEL GOVT 160928	2,900,000.00	2,850,120.00	
	3.25 BUND 150704	4,600,000.00	4,848,630.00	
	3.25 BUND 200104	4,500,000.00	4,600,665.00	

3.25 BUND 420704	900,000.00	865,008.00	
3.25 NETH GOVT 150715	3,000,000.00	3,142,800.00	
3.25 O.A.T 160425	5,300,000.00	5,489,210.00	
3.25 SPAIN GOVT 160430	200,000.00	188,370.00	
3.3 SPAIN GOVT 141031	3,200,000.00	3,122,240.00	
3.35 PORTUGUESE 151015	2,000,000.00	1,823,000.00	
3.375 FINNISH GOV 200415	1,300,000.00	1,316,250.00	
3.4 AUSTRIA GOVT 141020	2,300,000.00	2,412,930.00	
3.5 AUSTRIA GOVT 150715	2,500,000.00	2,622,000.00	
3.5 AUSTRIA GOVT 210915	2,700,000.00	2,698,650.00	
3.5 BEL GOVT 150328	1,900,000.00	1,925,270.00	
3.5 BUND 160104	5,000,000.00	5,314,000.00	
3.5 BUND 190704	5,400,000.00	5,643,108.00	
3.5 ITALY GOVT 140601	4,200,000.00	4,230,660.00	
3.5 NETH GOVT 200715	3,200,000.00	3,270,720.00	
3.5 O.A.T 150425	4,200,000.00	4,421,760.00	
3.5 O.A.T 200425	5,800,000.00	5,876,560.00	
3.5 O.A.T 260425	2,500,000.00	2,425,000.00	
3.5 OBL 130412	3,900,000.00	4,098,276.00	
3.6 PORTUGUESE 141015	1,400,000.00	1,317,190.00	
3.75 BEL GOVT 150928	2,600,000.00	2,646,280.00	
3.75 BEL GOVT 200928	3,700,000.00	3,606,020.00	
3.75 BTAN 120112	4,100,000.00	4,216,030.00	
3.75 BTAN 130112	4,600,000.00	4,821,720.00	
3.75 BUND 130704	4,800,000.00	5,086,848.00	
3.75 BUND 150104	5,500,000.00	5,902,270.00	
3.75 BUND 170104	4,200,000.00	4,508,322.00	
3.75 BUND 190104	5,100,000.00	5,434,254.00	
3.75 ITALY GOVT 131215	4,300,000.00	4,376,110.00	
3.75 ITALY GOVT 150801	5,700,000.00	5,739,900.00	
3.75 ITALY GOVT 160801	6,300,000.00	6,296,220.00	
3.75 ITALY GOVT 210301	3,200,000.00	2,982,400.00	
3.75 ITALY GOVT 210801	5,800,000.00	5,449,100.00	
3.75 NETH GOVT 140715	3,100,000.00	3,313,280.00	
3.75 NETH GOVT 230115	3,300,000.00	3,415,830.00	
3.75 NETH GOVT 420115	1,500,000.00	1,555,050.00	
3.75 O.A.T 170425	5,500,000.00	5,802,500.00	
3.75 O.A.T 191025	4,600,000.00	4,767,900.00	
3.75 O.A.T 210425	6,000,000.00	6,165,000.00	
3.8 AUSTRIA GOVT 131020	2,600,000.00	2,760,160.00	
3.8 SPAIN GOVT 170131	2,900,000.00	2,737,600.00	
3.85 PORTUGUESE 210415	2,000,000.00	1,650,000.00	
3.875 FINNISH GOVT170915	1,500,000.00	1,604,100.00	
3.9 AUSTRIA GOVT 200715	2,800,000.00	2,913,680.00	
3.9 IRISH GOVT 120305	1,300,000.00	1,283,490.00	
3.9 SPAIN GOVT 121031	3,100,000.00	3,115,500.00	
4 AUSTRIA GOVT 160915	2,300,000.00	2,457,550.00	
4 BEL GOVT 130328	2,700,000.00	2,796,930.00	
4 BEL GOVT 140328	2,400,000.00	2,488,560.00	
4 BEL GOVT 170328	2,400,000.00	2,440,320.00	
4 BEL GOVT 180328	2,100,000.00	2,123,940.00	
4 BEL GOVT 190328	2,300,000.00	2,313,340.00	
4 BEL GOVT 220328	2,700,000.00	2,662,200.00	
4 BUND 160704	5,600,000.00	6,087,368.00	
4 BUND 180104	4,300,000.00	4,667,736.00	
4 BUND 370104	5,000,000.00	5,386,900.00	
4 FINNISH GOVT 250704	1,100,000.00	1,154,450.00	
4 IRISH GOVT 140115	2,500,000.00	2,321,500.00	
4 ITALY GOVT 120415	3,600,000.00	3,677,040.00	
4 ITALY GOVT 170201	4,900,000.00	4,925,480.00	
4 ITALY GOVT 200901	4,600,000.00	4,420,600.00	
4 ITALY GOVT 370201	5,400,000.00	4,511,700.00	
4 NETH GOVT 160715	2,900,000.00	3,129,100.00	
4 NETH GOVT 180715	2,900,000.00	3,105,610.00	
4 NETH GOVT 190715	2,800,000.00	2,988,720.00	
4 NETH GOVT 370115	2,600,000.00	2,784,860.00	
4 O.A.T 130425	4,900,000.00	5,186,160.00	
4 O.A.T 131025	4,300,000.00	4,581,650.00	
4 O.A.T 140425	4,600,000.00	4,925,680.00	

4 O.A.T 141025	4,200,000.00	4,505,340.00	
4 O.A.T 180425	4,700,000.00	5,003,620.00	
4 O.A.T 381025	5,100,000.00	5,205,570.00	
4 O.A.T 550425	3,300,000.00	3,363,360.00	
4 O.A.T 600425	1,700,000.00	1,734,680.00	
4 OBL 120413	3,600,000.00	3,737,124.00	
4 OBL 131011	3,500,000.00	3,748,955.00	
4 SPAIN GOVT 200430	2,700,000.00	2,461,050.00	
4.1 PORTUGUESE 370415	1,500,000.00	1,058,250.00	
4.1 SPAIN GOVT 180730	3,700,000.00	3,482,810.00	
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	1,900,000.00	1,982,840.00	
4.2 PORTUGUESE 161015	1,300,000.00	1,185,600.00	
4.2 SPAIN GOVT 130730	3,200,000.00	3,248,640.00	
4.2 SPAIN GOVT 370131	3,300,000.00	2,587,860.00	
4.25 BEL GOVT 130928	2,900,000.00	3,030,500.00	
4.25 BEL GOVT 140928	2,600,000.00	2,718,300.00	
4.25 BEL GOVT 410328	1,000,000.00	950,100.00	
4.25 BUND 140104	5,300,000.00	5,729,035.00	
4.25 BUND 140704	6,100,000.00	6,631,493.00	
4.25 BUND 170704	4,000,000.00	4,406,680.00	
4.25 BUND 180704	4,500,000.00	4,953,690.00	
4.25 BUND 390704	3,000,000.00	3,407,670.00	
4.25 FINNISH GOVT 120915	1,300,000.00	1,366,040.00	
4.25 FINNISH GOVT 150704	1,000,000.00	1,089,900.00	
4.25 ITALY GOVT 121015	3,900,000.00	4,009,980.00	
4.25 ITALY GOVT 130415	3,800,000.00	3,914,760.00	
4.25 ITALY GOVT 130801	5,400,000.00	5,565,780.00	
4.25 ITALY GOVT 140801	5,900,000.00	6,077,590.00	
4.25 ITALY GOVT 150201	5,000,000.00	5,146,500.00	
4.25 ITALY GOVT 190201	4,900,000.00	4,883,830.00	
4.25 ITALY GOVT 190901	4,900,000.00	4,860,310.00	
4.25 ITALY GOVT 200301	4,800,000.00	4,719,360.00	
4.25 NETH GOVT 130715	3,400,000.00	3,638,680.00	
4.25 O.A.T 171025	4,400,000.00	4,764,320.00	
4.25 O.A.T 181025	4,200,000.00	4,536,420.00	
4.25 O.A.T 190425	6,000,000.00	6,469,200.00	
4.25 O.A.T 231025	5,000,000.00	5,333,000.00	
4.25 OBL 121012	3,600,000.00	3,795,948.00	
4.25 SPAIN GOVT 140131	2,800,000.00	2,838,080.00	
4.3 AUSTRIA GOVT 140715	2,100,000.00	2,266,320.00	
4.3 AUSTRIA GOVT 170915	1,400,000.00	1,514,100.00	
4.3 SPAIN GOVT 191031	3,000,000.00	2,813,700.00	
4.35 AUSTRIA GOVT 190315	2,400,000.00	2,589,840.00	
4.35 PORTUGUESE 171016	1,300,000.00	1,170,000.00	
4.375 FINNISH GOV 190704	1,300,000.00	1,423,370.00	
4.375 PORTUGUESE 140616	1,500,000.00	1,462,350.00	
4.4 IRISH GOVT 190618	1,900,000.00	1,469,460.00	
4.4 SPAIN GOVT 150131	3,700,000.00	3,739,220.00	
4.45 PORTUGUESE 180615	1,500,000.00	1,319,700.00	
4.5 BTAN 120712	4,500,000.00	4,724,550.00	
4.5 BTAN 130712	3,900,000.00	4,189,770.00	
4.5 BUND 130104	5,300,000.00	5,646,567.00	
4.5 IRISH GOVT 181018	1,800,000.00	1,434,960.00	
4.5 IRISH GOVT 200418	2,400,000.00	1,824,000.00	
4.5 ITALY GOVT 180201	4,800,000.00	4,903,200.00	
4.5 ITALY GOVT 180801	4,300,000.00	4,372,240.00	
4.5 ITALY GOVT 190301	4,900,000.00	4,956,350.00	
4.5 ITALY GOVT 200201	4,600,000.00	4,612,880.00	
4.5 ITALY GOVT 260301	1,800,000.00	1,710,000.00	
4.5 NETH GOVT 170715	2,800,000.00	3,094,560.00	
4.5 O.A.T 410425	2,800,000.00	3,095,120.00	
4.6 IRISH GOVT 160418	2,100,000.00	1,821,540.00	
4.6 SPAIN GOVT 190730	2,900,000.00	2,785,740.00	
4.65 AUSTRIA GOVT 180115	2,400,000.00	2,645,280.00	
4.65 SPAIN GOVT 250730	2,800,000.00	2,511,880.00	
4.7 SPAIN GOVT 410730	2,000,000.00	1,673,600.00	
4.75 BUND 280704	2,400,000.00	2,777,856.00	
4.75 BUND 340704	4,200,000.00	4,985,190.00	
4.75 BUND 400704	3,400,000.00	4,181,490.00	

4.75 ITALY GOVT 130201	4,500,000.00	4,681,350.00	
4.75 ITALY GOVT 230801	4,100,000.00	4,093,030.00	
4.75 O.A.T 121025	4,700,000.00	4,992,340.00	
4.75 O.A.T 350425	3,900,000.00	4,427,670.00	
4.75 PORTUGUESE 190614	1,500,000.00	1,346,250.00	
4.75 SPAIN GOVT 140730	3,300,000.00	3,389,100.00	
4.8 PORTUGUESE 200615	1,600,000.00	1,408,000.00	
4.8 SPAIN GOVT 240131	3,300,000.00	3,081,540.00	
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	800,000.00	897,920.00	
4.85 SPAIN GOVT 201031	2,800,000.00	2,700,880.00	
4.9 SPAIN GOVT 400730	2,900,000.00	2,535,760.00	
4.95 PORTUGUESE 231025	1,300,000.00	1,103,050.00	
5 AUSTRIA GOVT 120715	2,200,000.00	2,325,840.00	
5 BEL GOVT 120928	2,800,000.00	2,939,720.00	
5 BEL GOVT 350328	3,000,000.00	3,221,400.00	
5 BUND 120104	5,500,000.00	5,727,150.00	
5 BUND 120704	5,800,000.00	6,133,500.00	
5 IRISH GOVT 130418	1,200,000.00	1,159,320.00	
5 IRISH GOVT 201018	1,400,000.00	1,084,580.00	
5 ITALY GOVT 120201	5,900,000.00	6,075,584.00	
5 ITALY GOVT 250301	4,100,000.00	4,129,930.00	
5 ITALY GOVT 340801	4,500,000.00	4,353,750.00	
5 ITALY GOVT 390801	3,900,000.00	3,747,120.00	
5 ITALY GOVT 400901	3,600,000.00	3,436,920.00	
5 NETH GOVT 120715	3,000,000.00	3,174,600.00	
5 O.A.T 120425	4,400,000.00	4,620,880.00	
5 O.A.T 161025	5,300,000.00	5,964,090.00	
5 PORTUGUESE 120615	1,800,000.00	1,832,040.00	
5 SPAIN GOVT 120730	2,800,000.00	2,873,360.00	
5.25 ITALY GOVT 170801	5,100,000.00	5,448,840.00	
5.25 ITALY GOVT 291101	5,800,000.00	5,872,500.00	
5.375 FINNISH GOVT130704	1,300,000.00	1,426,360.00	
5.4 IRISH GOVT 250313	1,900,000.00	1,425,000.00	
5.45 PORTUGUESE 130923	1,800,000.00	1,823,220.00	
5.5 BEL GOVT 170928	1,900,000.00	2,094,180.00	
5.5 BEL GOVT 280328	3,100,000.00	3,491,220.00	
5.5 BUND 310104	3,700,000.00	4,698,223.00	
5.5 NETH GOVT 280115	2,300,000.00	2,856,600.00	
5.5 O.A.T 290425	4,300,000.00	5,233,530.00	
5.5 SPAIN GOVT 170730	3,300,000.00	3,414,840.00	
5.625 BUND 280104	3,100,000.00	3,920,508.00	
5.75 ITALY GOVT 330201	3,400,000.00	3,595,500.00	
5.75 O.A.T 321025	4,300,000.00	5,476,050.00	
5.75 SPAIN GOVT 320730	2,800,000.00	2,768,920.00	
5.9 IRISH GOVT 191018	1,400,000.00	1,196,020.00	
6 BUND 160620	300,000.00	355,455.00	
6 ITALY GOVT 310501	6,300,000.00	6,858,180.00	
6 O.A.T 251025	3,400,000.00	4,294,200.00	
6 SPAIN GOVT 290131	3,800,000.00	3,883,980.00	
6.15 SPAIN GOVT 130131	3,200,000.00	3,362,240.00	
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	2,300,000.00	2,990,460.00	
6.25 BUND 240104	2,300,000.00	3,013,322.00	
6.25 BUND 300104	2,000,000.00	2,744,780.00	
6.5 BUND 270704	2,400,000.00	3,292,296.00	
6.5 ITALY GOVT 271101	5,600,000.00	6,440,000.00	
7.25 ITALY GOVT 261101	2,000,000.00	2,460,600.00	
8 BEL GOVT 121224	1,800,000.00	1,997,460.00	
8 BEL GOVT 150328	1,400,000.00	1,663,060.00	
8.5 O.A.T 121226	1,400,000.00	1,594,040.00	
8.5 O.A.T 191025	2,200,000.00	3,087,260.00	
8.5 O.A.T 230425	2,500,000.00	3,741,750.00	
9 ITALY GOVT 231101	2,700,000.00	3,746,250.00	
国債証券 小計	797,300,000.00	825,808,280.00 (91,532,589,755)	
ユーロ 小計	797,300,000.00	825,808,280.00 (91,532,589,755)	
合 計		214,802,089,979 (214,802,089,979)	

(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 183銘柄	100.00%	40.42%
カナダドル	国債証券 30銘柄	100.00%	2.91%
オーストラリアドル	国債証券 14銘柄	100.00%	1.09%
イギリスポンド	国債証券 34銘柄	100.00%	7.85%
スイスフラン	国債証券 9銘柄	100.00%	0.52%
シンガポールドル	国債証券 17銘柄	100.00%	0.39%
マレーシアリンギット	国債証券 12銘柄	100.00%	0.55%
スウェーデンクローネ	国債証券 8銘柄	100.00%	0.68%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	100.00%	0.26%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.00%	0.85%
メキシコペソ	国債証券 18銘柄	100.00%	0.91%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.00%	0.95%
ユーロ	国債証券 243銘柄	100.00%	42.61%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

2【ファンドの現況】  
【純資産額計算書】

平成23年1月31日現在  
(単位：円)

資産総額	2,406,343,025
負債総額	1,081,424
純資産総額( - )	2,405,261,601
発行済口数	2,929,454,841 口
1口当たり純資産価額( / )	0.8211 ( 1万口当たり 8,211 )

<参考>

「三菱UFJ 外国債券マザーファンド」の現況  
純資産額計算書

平成23年1月31日現在  
(単位：円)

資産総額	216,365,086,113
負債総額	993,353,160
純資産総額( - )	215,371,732,953
発行済口数	129,718,367,013 口
1口当たり純資産価額( / )	1.6603 ( 1万口当たり 16,603 )

[前へ](#)

## 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たと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23年1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ファンド毎の運用戦略を決定します。

###### 運用計画の決定

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

###### ポートフォリオの構築

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

###### 投資行動のモニタリング1

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

###### 投資行動のモニタリング2

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

###### ファンドに係る法人等の管理

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

###### 運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（5名程度）は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

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

ファンドの運用体制等は平成23年1月末現在のものであり、今後変更される可能性があります。

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

等を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成23年1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	339	6,118,331
追加型公社債投資信託	18	427,608
単位型株式投資信託	12	83,371
単位型公社債投資信託	8	145,549
合計	377	6,774,860

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

### 3【委託会社等の経理状況】

#### (1) 財務諸表の作成方法について

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

第24期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）は、改正前の財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき、第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）は、改正後の財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和52年大蔵省令第38号）」（以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

なお、財務諸表及び中間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24期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）の財務諸表については、監査法人トーマツによる監査を受けており、第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）の財務諸表については、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。また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期事業年度に係る中間会計期間（自平成22年4月1日至平成22年9月30日）の中間財務諸表については、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

なお、監査法人トーマツは、監査法人の種類の変更により、平成21年7月1日をもって有限責任監査法人トーマツとなりました。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第24期 (平成21年3月31日現在)		第25期 (平成22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	8,398,952	2	8,675,536
有価証券	2	11,498,934	2	14,000,000
前払費用		130,052		136,193
未収入金		133,300	2	45,397
未収委託者報酬		3,496,056		4,345,110
未収収益	2	77,468	2	43,835
繰延税金資産		289,685		407,456
金銭の信託	2	1,000,000	2	500,000
その他		13,229		8,190
<b>流動資産合計</b>		<b>25,037,680</b>		<b>28,161,721</b>
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
建物	1	368,327	1	333,687
器具備品	1	168,906	1	158,971
土地		1,205,031		1,205,031
<b>有形固定資産合計</b>		<b>1,742,265</b>		<b>1,697,691</b>
<b>無形固定資産</b>				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		809,683		787,767
ソフトウェア仮勘定		7,316		72,475
その他		156		112
<b>無形固定資産合計</b>		<b>832,978</b>		<b>876,178</b>
<b>投資その他の資産</b>				
投資有価証券		11,906,934		11,797,311
関係会社株式		431,812		431,812
長期性預金	2	2,000,000	2	5,000,000
長期差入保証金	2	844,978	2	1,030,783
長期前払費用		4,371		142
繰延税金資産		473,766		474,632
その他		20,485		16,075
<b>投資その他の資産合計</b>		<b>15,682,348</b>		<b>18,750,756</b>
<b>固定資産合計</b>		<b>18,257,593</b>		<b>21,324,626</b>
<b>資産合計</b>		<b>43,295,274</b>		<b>49,486,347</b>

(単位：千円)

	第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
<b>(負債の部)</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	1,038,438	51,838
未払金		
未払収益分配金	272,705	274,776
未払償還金	2,047,207	1,607,485
未払手数料	2 1,440,183	2 1,748,905
その他未払金	110,716	52,889
未払費用	2 781,556	2 1,034,566
未払消費税等		104,853
未払法人税等	595,981	1,727,215
仮受金	43	
賞与引当金	478,200	580,826
デリバティブ債務		7,536
<b>流動負債合計</b>	<b>6,765,032</b>	<b>7,190,892</b>
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	13,304	68,206
役員退職慰労引当金	54,658	66,197
<b>固定負債合計</b>	<b>67,962</b>	<b>134,404</b>
<b>負債合計</b>	<b>6,832,995</b>	<b>7,325,296</b>
<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
<b>資本剰余金合計</b>	<b>222,096</b>	<b>222,096</b>
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	27,520,492	31,383,254
<b>利益剰余金合計</b>	<b>34,861,082</b>	<b>38,723,843</b>
<b>株主資本合計</b>	<b>37,083,309</b>	<b>40,946,071</b>
評価・換算差額等		
その他有価証券	621,031	1,277,237
評価差額金		
繰延ヘッジ損益		62,258
<b>評価・換算差額等合計</b>	<b>621,031</b>	<b>1,214,979</b>
<b>純資産合計</b>	<b>36,462,278</b>	<b>42,161,050</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>43,295,274</b>	<b>49,486,347</b>



## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第24期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)		第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		42,137,383		40,630,847
その他営業収益				
投資顧問料		7,887		7,619
その他		8,381		85,040
営業収益合計		42,153,652		40,723,506
営業費用				
支払手数料	2	18,452,482	2	17,208,659
広告宣伝費		911,798		579,833
公告費		4,088		7,195
調査費				
調査費		778,991		799,697
委託調査費		4,427,117		5,231,920
事務委託費		229,877		183,931
営業雑経費				
通信費		114,009		98,055
印刷費		640,249		607,867
協会費		42,295		35,983
諸会費		6,356		5,761
事務機器関連費		820,190		841,349
営業費用合計		26,427,456		25,600,255
一般管理費				
給料				
役員報酬		171,783		194,520
給料・手当		3,243,471		3,445,656
賞与引当金繰入		478,200		580,826
福利厚生費		427,372		458,092
交際費		20,785		21,080
旅費交通費		126,644		108,299
租税公課		112,608		102,967
不動産賃借料		658,309		654,768
退職給付費用		151,382		177,435
役員退職慰労引当金繰入		17,566		18,448
固定資産減価償却費		345,975		382,798
諸経費		368,982		287,163
一般管理費合計		6,123,082		6,432,057
営業利益		9,603,113		8,691,194

(単位：千円)

	第24期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)		第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		185,609		30,250
有価証券利息	2	55,030	2	29,170
受取利息	2	21,926	2	19,853
投資有価証券償還益				73,517
収益分配金等時効完成分		111,003		421,674
その他		5,225		8,586
営業外収益合計		378,796		583,053
営業外費用				
投資有価証券償還損				181,632
収益分配金等時効完成分支払額		62,259		10,520
事務過誤費		13,871		7,510
その他		7,266		3,626
営業外費用合計		83,398		203,289
経常利益		9,898,511		9,070,957
特別利益				
投資有価証券売却益		15,399		231,903
ゴルフ会員権売却益				10,190
特別利益合計		15,399		242,093
特別損失				
投資有価証券売却損		228,868		129,159
投資有価証券評価損		2,124,730		
固定資産除却損	1	2,488	1	701
その他		5,965		
特別損失合計		2,362,053		129,860
税引前当期純利益		7,551,856		9,183,190
法人税、住民税及び事業税		3,801,688		3,627,233
法人税等調整額		144,759		118,635
法人税等合計		3,946,448		3,508,597
当期純利益		3,605,408		5,674,592

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第24期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	2,000,131	2,000,131
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	222,096	222,096
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	222,096	222,096
資本剰余金合計		
前期末残高	222,096	222,096
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	222,096	222,096
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	342,589	342,589
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	6,998,000	6,998,000
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金		
前期末残高	28,643,217	27,520,492
当期変動額		
剰余金の配当	4,728,133	1,811,830
当期純利益	3,605,408	5,674,592
当期変動額合計	1,122,725	3,862,761
当期末残高	27,520,492	31,383,254
利益剰余金合計		
前期末残高	35,983,807	34,861,082
当期変動額		
剰余金の配当	4,728,133	1,811,830
当期純利益	3,605,408	5,674,592
当期変動額合計	1,122,725	3,862,761
当期末残高	34,861,082	38,723,843
株主資本合計		
前期末残高	38,206,035	37,083,309
当期変動額		
剰余金の配当	4,728,133	1,811,830
当期純利益	3,605,408	5,674,592
当期変動額合計	1,122,725	3,862,761
当期末残高	37,083,309	40,946,071
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	119,404	621,031
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	501,627	1,898,269
当期変動額合計	501,627	1,898,269
当期末残高	621,031	1,277,237
繰延ヘッジ損益		
前期末残高		
当期変動額		

株主資本以外の項目の当期変動額(純額)		62,258
当期変動額合計		62,258
当期末残高		62,258
評価・換算差額等合計		
前期末残高	119,404	621,031
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	501,627	1,836,011
当期変動額合計	501,627	1,836,011
当期末残高	621,031	1,214,979
純資産合計		
前期末残高	38,086,630	36,462,278
当期変動額		
剰余金の配当	4,728,133	1,811,830
当期純利益	3,605,408	5,674,592
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	501,627	1,836,011
当期変動額合計	1,624,352	5,698,772
当期末残高	36,462,278	42,161,050

## 重要な会計方針

項目	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	子会社株式：移動平均法による原価法によっております。 その他有価証券： 時価のあるものは決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)によっております。 時価のないものは移動平均法による原価法によっております。	同 左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	-	時価法によっております。
3. 固定資産の減価償却の方法		
(1) 有形固定資産	定率法を採用しております。 なお、主な耐用年数は、建物38年であります。	同 左
(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェア	社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。	同 左
それ以外の無形固定資産	定額法を採用しております。	同 左
4. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。	同 左
5. 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。	同 左
(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。 数理計算上の差異は、その発生年度の従業員の平均支払期間以内の一定の年数(8年)による定額法により、翌事業年度より費用処理することとしております。	同 左
(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。	同 左
6. ヘッジ会計の手法		
(1) ヘッジ会計の方法	-	繰延ヘッジ処理によっております。
(2) ヘッジ手段とヘッジ対象	-	当事業年度にヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。 a. ヘッジ手段... 株価指数先物 ヘッジ対象... 投資有価証券 b. ヘッジ手段... 株式関連オプション ヘッジ対象... 投資有価証券
(3) ヘッジ方針	-	当社の内規である「ヘッジ取引に関する内規」に基づき、ヘッジ対象に係る価格変動リスクを一定の範囲内でヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法	-	ヘッジ対象の騰落率とヘッジ手段の騰落率を比較し、両者の変動額を基礎にして、有効性を評価しております。
7.消費税等の会計処理	税抜方式によっております。	同 左

## 重要な会計方針の変更

第24期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
-	当事業年度より、「退職給付に係る会計基準」の一部改正(その3) (企業会計基準第19号 平成20年7月31日)を適用しております。なお、これによる営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響はありません。

## 注記事項

(貸借対照表関係)

項目	第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物 117,264千円 器具備品 130,206千円	建物 152,240千円 器具備品 167,633千円
2.関係会社に対する主な資産・負債	区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。 預金 5,493,354千円 有価証券 11,000,000千円 未収収益 5,233千円 金銭の信託 1,000,000千円 長期性預金 2,000,000千円 長期差入保証金 837,940千円 未払手数料 868,907千円 未払費用 198,857千円	区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。 預金 5,272,377千円 有価証券 14,000,000千円 未収入金 2,072千円 未収収益 43,545千円 金銭の信託 500,000千円 長期性預金 5,000,000千円 長期差入保証金 837,940千円 未払手数料 1,005,639千円 未払費用 153,908千円

## （損益計算書関係）

項目	第24期 （自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）		第25期 （自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）	
	1. 固定資産除却損の内 訳	器具備品 1,961千円	ソフトウェア 527千円	器具備品 701千円
2. 関係会社に対する 主な取引	区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。 支払手数料 12,493,304千円 有価証券利息 44,704千円 受取利息 21,926千円		区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。 支払手数料 11,148,518千円 有価証券利息 26,197千円 受取利息 19,853千円	

## （株主資本等変動計算書関係）

第24期（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

配当金の総額	1,811,830千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	14,600円
基準日	平成21年3月31日
効力発生日	平成21年6月30日

第25期（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

配当金の総額	1,811,830千円
1株当たり配当額	14,600円
基準日	平成21年3月31日
効力発生日	平成21年6月30日

- (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22年6月30日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	2,841,844千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	22,900円
基準日	平成22年3月31日
効力発生日	平成22年7月1日

(金融商品関係)

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

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。このうち一部の投資信託については価格変動リスクを回避するために、デリバティブ取引を行っております。

デリバティブ取引は、投資信託に係る価格変動リスクに対するヘッジを目的とした先物取引及びオプション取引であります。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「6.ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

デリバティブ取引の利用にあたっては、カウンターパーティーリスクを軽減するために、格付の高い金融機関とのみ取引を行っております。

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

投資信託については、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。

デリバティブ取引については、内部管理規程に従い、実需の範囲で行うこととしております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。また、注記事項「デリバティブ取引関係」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日(当期の決算日)における貸借対照表計上額、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)。

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金及び預金	8,675,536	8,675,536	-
(2) 有価証券	14,000,000	14,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	4,345,110	4,345,110	-
(4) 長期性預金	5,000,000	5,007,477	7,477
(5) 投資有価証券	11,533,054	11,533,054	-
(6) 未払手数料	(1,748,905)	(1,748,905)	-
(7) 未払法人税等	(1,727,215)	(1,727,215)	-
(8) デリバティブ取引(*2)	(7,536)	(7,536)	-

(\*1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。



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

## (1) 現金及び預金、(2) 有価証券並びに(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。なお、有価証券はすべて短期決済される譲渡性預金であります。

## (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、公表されている基準価額によっております。

## (6) 未払手数料、並びに(7) 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。

## (8) デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式(貸借対照表計上額264,257千円)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、「(5) 投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式431,812千円)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。

## (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

(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	8,675,536	-	-	-
未収委託者報酬	4,345,110	-	-	-
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	14,000,000	-	-	-
投資信託	-	3,044,412	62,645	-
長期性預金	-	5,000,000	-	-
合計	27,020,647	8,044,412	62,645	-

## (追加情報)

当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日)を適用しております。

(有価証券関係)

第24期（平成21年3月31日現在）

## 1. その他有価証券で時価のあるもの

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

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

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

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

## 3. 時価評価されていない主な有価証券の内容

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

## 4. その他有価証券のうち満期があるものの今後の償還予定

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

第25期（平成22年3月31日現在）

## 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（貸借対照表計上額 関係会社株式431,812千円）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

	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	6,083,784	4,825,309	1,258,474
	小計	6,083,784	4,825,309	1,258,474
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	5,449,270	5,692,652	243,382
	小計	5,449,270	5,692,652	243,382
合計		11,533,054	10,517,961	1,015,092

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額264,257千円）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ことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券（自平成21年4月1日至平成22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	11,600	-	10,920
債券	-	-	-
その他	1,988,176	253,043	118,239
合計	1,999,776	253,043	129,159

## （デリバティブ取引関係）

第24期（自平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

第25期（自平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当するものではありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

株式関連

（単位：千円）

ヘッジ会計の手法	取引の種類	主なヘッジ対象	当事業年度（平成22年3月31日）		
			契約額等	契約額等のうち1年超	時価
原則的処理方法	先物取引（売建）	投資有価証券	373,043	-	7,536

（注）時価の算定方法 取引所の価格及び決算日の為替レートによっております。

## （退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

	第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
(1)退職給付債務	771,109	661,846
(2)年金資産	454,977	416,582
(3)未積立退職給付債務 (1)+(2)	316,132	245,263
(4)未認識数理計算上の差異	306,966	177,056
(5)貸借対照表計上額純額 (3)+(4)	9,164	68,206
(6)前払年金費用	4,139	
(7)退職給付引当金 (5) - (6)	13,304	68,206

3. 退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
(1)勤務費用	29,439	28,685
(2)利息費用	12,676	11,367
(3)期待運用収益	10,905	6,824
(4)数理計算上の差異の費用処理額	38,186	57,581
(5)退職給付費用	69,396	90,809
(6)その他	81,986	86,626
(7)合計	151,382	177,435

（注）「(6)その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

## 4. 退職給付の計算基礎に関する事項

	第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
(1) 割引率	1.5%	同左
(2) 期待運用収益率	1.5%	同左
(3) 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準	同左
(4) 数理計算上の差異の処理年数	各事業年度の発生時における従業員 の平均支払期間以内の一定の年数 (8年)による定額法により、翌事業 年度より費用処理しております。	
		同左

(税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位：千円)

	第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	689,220	669,724
投資有価証券評価損	1,041,250	849,883
ゴルフ会員権評価損	30,885	9,710
未払事業税	49,084	136,281
賞与引当金	194,579	236,338
役員退職慰労引当金	22,240	26,935
退職給付引当金	5,413	27,753
退職一時金未払	14,992	-
減価償却超過額	63,725	54,520
委託者報酬	124,519	106,666
その他有価証券評価差額金	377,217	-
その他	32,298	62,287
繰延税金資産 小計	2,645,429	2,180,101
評価性引当額	1,880,292	1,298,012
繰延税金資産 合計	765,137	882,088
繰延税金負債		
前払年金費用	1,684	-
繰延税金負債 合計	1,684	-
繰延税金資産(負債)の純額	763,452	882,088

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異原因

	第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
	(%)	(%)
法定実効税率	40.7	法定実効税率 40.7
(調整)		(調整)
投資有価証券評価損に係る損金不算入	11.4	投資有価証券評価損認容 2.1
その他	0.2	その他 0.4
税効果会計適用後の法人税等の負担率	52.3	税効果会計適用後の法人税等の負担率 38.2

(関連当事者情報)

第24期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

(追加情報)

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

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

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

事務所敷金及び賃借料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。

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

## (2) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 2. 親会社に関する注記

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

第25期（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高	
主要株主	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 30.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	4,064,069 千円	未払手数料	285,840 千円	
							事務所の賃借料	631,409 千円	長期差入保証金	833,144 千円	
							投資の助言	186,556 千円	未払費用	99,917 千円	
主要株主	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	7,084,449 千円	未払手数料	719,799 千円	
							取引銀行	譲渡性預金の預入	49,000,000 千円	有価証券	14,000,000 千円
								譲渡性預金に係る受取利息	26,197 千円	未収利息	1,234 千円
								マルチコーラブル預金の預入	5,000,000 千円	長期性預金	5,000,000 千円
		マルチコーラブル預金に係る受取利息	16,869 千円	未収利息	1,597 千円						

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

事務所敷金及び賃借料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢等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

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証券(株)	東京都千代田区	65,518百万円	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	2,822,731千円	未払手数料	397,272千円

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 2. 親会社に関する注記

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

## (1株当たり情報)

項目	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
1株当たり純資産額	293,818円41銭	339,739円97銭
1株当たり当期純利益	29,052円91銭	45,726円70銭

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

## 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

項目	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
当期純利益(千円)	3,605,408	5,674,592
普通株式に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	3,605,408	5,674,592
期中平均株式数(株)	124,098	124,098

[次へ](#)

中間財務諸表  
(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

		第26期中間会計期間末 (平成22年9月30日現在)
<b>(資産の部)</b>		
<b>流動資産</b>		
現金及び預金		12,246,376
有価証券		10,000,000
前払費用		277,701
未収入金		18,638
未収委託者報酬		4,510,919
未収収益		72,691
繰延税金資産		437,087
金銭の信託		500,000
その他		11,049
<b>流動資産合計</b>		<b>28,074,464</b>
<b>固定資産</b>		
<b>有形固定資産</b>		
建物	1	322,074
器具備品	1	159,587
土地		1,205,031
<b>有形固定資産合計</b>		<b>1,686,693</b>
<b>無形固定資産</b>		
電話加入権		15,822
ソフトウェア		796,045
ソフトウェア仮勘定		72,179
その他		90
<b>無形固定資産合計</b>		<b>884,138</b>
<b>投資その他の資産</b>		
投資有価証券		10,318,197
関係会社株式		431,812
長期性預金		7,000,000
長期差入保証金		809,202
長期前払費用		97
繰延税金資産		480,181
その他		15,075
<b>投資その他の資産合計</b>		<b>19,054,566</b>
<b>固定資産合計</b>		<b>21,625,398</b>
<b>資産合計</b>		<b>49,699,862</b>



第26期中間会計期間末  
(平成22年9月30日現在)

(負債の部)	
流動負債	
預り金	50,459
未払金	
未払収益分配金	266,607
未払償還金	1,796,502
未払手数料	1,785,006
その他未払金	81,029
未払費用	1,156,525
未払消費税等	149,538
未払法人税等	1,760,758
賞与引当金	656,000
その他	214,187
流動負債合計	7,916,616
固定負債	
退職給付引当金	83,995
役員退職慰労引当金	66,916
時効後支払損引当金	192,217
固定負債合計	343,129
負債合計	8,259,745
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,131
資本剰余金	
資本準備金	222,096
資本剰余金合計	222,096
利益剰余金	
利益準備金	342,589
その他利益剰余金	
別途積立金	6,998,000
繰越利益剰余金	31,652,574
利益剰余金合計	38,993,163
株主資本合計	41,215,391
評価・換算差額等	
その他有価証券	225,175
評価差額金	
繰延ヘッジ損益	450
評価・換算差額等合計	224,725
純資産合計	41,440,116
負債純資産合計	49,699,862

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日 至平成22年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	23,287,269
その他営業収益	
投資顧問料	7,333
その他	118,054
営業収益合計	23,412,657
営業費用	
支払手数料	9,587,373
広告宣伝費	374,419
公告費	6,687
調査費	
調査費	453,492
委託調査費	4,006,865
事務委託費	119,404
営業雑経費	
通信費	51,687
印刷費	311,998
協会費	18,808
諸会費	2,975
事務機器関連費	427,684
営業費用合計	15,361,397
一般管理費	
給料	
役員報酬	99,326
給料・手当	1,489,872
賞与引当金繰入	656,000
福利厚生費	236,048
交際費	9,438
旅費交通費	79,545
租税公課	53,700
不動産賃借料	327,512
退職給付費用	81,313
役員退職慰労引当金繰入	8,999
固定資産減価償却費	197,630
諸経費	160,885
一般管理費合計	3,400,272
営業利益	4,650,986

(単位：千円)

第26期中間会計期間  
 (自平成22年4月1日  
 至平成22年9月30日)

営業外収益	
受取配当金	20,632
有価証券利息	6,270
受取利息	9,437
投資有価証券償還益	364,801
収益分配金等時効完成分	21,599
その他	5,559
営業外収益合計	428,301
営業外費用	
投資有価証券償還損	192,004
その他	33,417
営業外費用合計	225,421
経常利益	4,853,866
特別利益	
投資有価証券売却益	295,698
時効後支払損引当金戻入益	4,812
特別利益合計	300,510
特別損失	
投資有価証券売却損	52,222
過年度時効後支払損引当金繰入	204,138
資産除去債務会計基準の 適用に伴う影響額	37,264
固定資産除却損	3,383
その他	2,340
特別損失合計	299,349
税引前中間純利益	4,855,027
法人税、住民税及び事業税	1,780,389
法人税等調整額	36,525
法人税等合計	1,743,863
中間純利益	3,111,164

## (3) 中間株主資本等変動計算書

	第26期中間会計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)
株主資本	
資本金	
前期末残高	2,000,131
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	
当中間期末残高	2,000,131
資本剰余金	
資本準備金	
前期末残高	222,096
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	
当中間期末残高	222,096
資本剰余金合計	
前期末残高	222,096
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	
当中間期末残高	222,096
利益剰余金	
利益準備金	
前期末残高	342,589
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	
当中間期末残高	342,589
その他利益剰余金	
別途積立金	
前期末残高	6,998,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	
当中間期末残高	6,998,000
繰越利益剰余金	
前期末残高	31,383,254
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,841,844
中間純利益	3,111,164
当中間期変動額合計	269,320
当中間期末残高	31,652,574
利益剰余金合計	
前期末残高	38,723,843
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,841,844
中間純利益	3,111,164
当中間期変動額合計	269,320
当中間期末残高	38,993,163
株主資本合計	
前期末残高	40,946,071
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,841,844
中間純利益	3,111,164
当中間期変動額合計	269,320
当中間期末残高	41,215,391
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
前期末残高	1,277,237
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	1,052,062
当中間期変動額合計	1,052,062
当中間期末残高	225,175
繰延ヘッジ損益	
前期末残高	62,258

当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	61,808
当中間期変動額合計	61,808
当中間期末残高	450
評価・換算差額等合計	
前期末残高	1,214,979
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	990,254
当中間期変動額合計	990,254
当中間期末残高	224,725
純資産合計	
前期末残高	42,161,050
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,841,844
中間純利益	3,111,164
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	990,254
当中間期変動額合計	720,934
当中間期末残高	41,440,116

## 中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

項目	第26期中間会計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)
1. 資産の評価基準及び評価方法	(有価証券) 子会社株式：移動平均法による原価法によっております。 その他有価証券： 時価のあるものは中間決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)によっております。 時価のないものは移動平均法による原価法によっております。
2. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産  (2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェア  それ以外の無形固定資産	定率法を採用しております。 なお、主な耐用年数は、建物38年であります。  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。  定額法を採用しております。
3. 引当金の計上基準 (1) 賞与引当金  (2) 退職給付引当金    (3) 役員退職慰労引当金 (4) 時効後支払損引当金	従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。  従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 数理計算上の差異は、その発生年度の従業員の平均支払期間以内の一定の年数(8年)による定額法により、翌事業年度より費用処理することとしております。  役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく中間期末要支給額を計上しております。 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。
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(消費税等の会計処理) 税抜方式によっております。

## 中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項の変更

第26期中間会計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)
(資産除去債務に関する会計基準の適用) 当中間会計期間より、「資産除去債務に関する会計基準」(企業会計基準第18号 平成20年3月31日)及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日)を適用しております。 これにより、営業利益、経常利益はそれぞれ6,042千円、税引前中間純利益は43,307千円減少しております。

## 追加情報

第26期中間会計期間  
（自 平成22年4月1日  
至 平成22年9月30日）

従来は時効が成立し、利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者から支払請求を受けた時点で支払予定額を費用計上しておりましたが、信頼性のある見積もりを行うための社内体制を整備し、当中間会計期間より将来の支払見込額を合理的に見積もることが可能となりました。そのため、当中間会計期間より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「時効後支払損引当金」として計上しております。  
この結果、従来の方法に比べて経常利益は7,108千円多く計上され、税引前中間純利益は192,217千円少なく計上されています。

## 注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第26期中間会計期間末 （平成22年9月30日現在）	
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物 器具備品	165,554千円 195,507千円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。	

（中間損益計算書関係）

項目	第26期中間会計期間 （自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）	
1.減価償却実施額	有形固定資産 無形固定資産	43,425千円 154,205千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第26期中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	前事業年度末 株式数（株）	当中間会計期間 増加株式数（株）	当中間会計期間 減少株式数（株）	当中間会計期間末 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

平成22年6月30日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	2,841,844千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	22,900円
基準日	平成22年3月31日
効力発生日	平成22年7月1日

(金融商品関係)

第26期中間会計期間末(平成22年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

平成22年9月30日における中間貸借対照表計上額、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)。

(単位:千円)

	中間貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金及び預金	12,246,376	12,246,376	-
(2) 有価証券	10,000,000	10,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	4,510,919	4,510,919	-
(4) 長期性預金	7,000,000	7,013,474	13,474
(5) 投資有価証券	10,053,940	10,053,940	-
(6) 未払手数料	(1,785,006)	(1,785,006)	-
(7) 未払法人税等	(1,760,758)	(1,760,758)	-

(\*1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(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

(1)現金及び預金、(2)有価証券並びに(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。なお、有価証券はすべて短期決済される譲渡性預金であります。

(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、公表されている基準価額によっております。

(6)未払手数料、並びに(7)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

非上場株式(中間貸借対照表計上額264,257千円)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、「(5)投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式(中間貸借対照表計上額 関係会社株式431,812千円)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。

(注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。



## (有価証券関係)

第26期中間会計期間末(平成22年9月30日)

## 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(中間貸借対照表計上額 関係会社株式431,812千円)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

	種類	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	5,391,686	5,007,348	384,338
	小計	5,391,686	5,007,348	384,338
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	4,662,253	4,820,071	157,817
	小計	4,662,253	4,820,071	157,817
合計		10,053,940	9,827,419	226,520

(注)非上場株式(中間貸借対照表計上額264,257千円)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ことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## (デリバティブ取引関係)

第26期中間会計期間(自平成22年4月1日至平成22年9月30日)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

重要な取引はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

重要な取引はありません。

## (セグメント情報等)

## [セグメント情報]

第26期中間会計期間(自平成22年4月1日至平成22年9月30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26期中間会計期間(自平成22年4月1日至平成22年9月30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中間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

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 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]

第26期中間会計期間(自平成22年4月1日至平成22年9月30日)

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 ]

第26期中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）

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 ]

第26期中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）

該当事項はありません。

## （追加情報）

第26期中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）

当中間会計期間より、「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（企業会計基準第17号 平成21年3月27日）及び「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用方針」（企業会計基準適用指針第20号 平成20年3月21日）を適用しております。

## （1株当たり情報）

項目	第26期中間会計期間 （自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）
1株当たり純資産額	333,930円57銭
1株当たり中間純利益金額	25,070円22銭

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

## 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

項目	第26期中間会計期間 （自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）
中間純利益（千円）	3,111,164
普通株式に帰属しない金額（千円）	-
普通株式に係る中間純利益（千円）	3,111,164
期中平均株式数（株）	124,098

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の特別決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（平成22年9月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

名称	資本金の額 (平成22年9月末現在)	事業の内容
楽天銀行株式会社	23,485 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社八十二銀行	52,243 百万円	銀行業務を営んでいます。
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
カブドットコム証券株式会社	7,196 百万円	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。
東海東京証券株式会社	6,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	7,425 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	5,207 百万円 (平成22年11月25日現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

### 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23年4月1日現在）

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】

当計算期間において、次の書類を関東財務局長に提出しております。

平成22年10月15日 半期報告書、有価証券届出書の訂正届出書

平成22年4月16日 有価証券報告書、有価証券届出書

平成22年3月3日 有価証券届出書の訂正届出書

## 独立監査人の監査報告書

平成23年2月22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 荒川 進 印  
業務執行社員指定社員 公認会計士 鶴田光夫 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（年1回決算型）の平成22年1月19日から平成23年1月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ世界国債インデックスファンド（年1回決算型）の平成23年1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計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

三菱UFJ投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

平成22年6月30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	村山 周平 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	後藤 徳彌 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	五十幡 理一郎 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ投信株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第25期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ投信株式会社の平成22年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

平成22年12月13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	村山 周平	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	後藤 徳彌	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22年4月1日から平成23年3月31日までの第26期事業年度の中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間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、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ投信株式会社の平成22年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の中間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。

[前へ](#)



## 独立監査人の監査報告書

平成22年2月24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 荒川 進 印  
業務執行社員指定社員 公認会計士 鶴田光夫 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（年1回決算型）の平成21年1月20日から平成22年1月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ世界国債インデックスファンド（年1回決算型）の平成22年1月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

三菱UFJ投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

平成21年6月30日

三菱UFJ投信株式会社

取締役会 御中

監査法人 トーマツ

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ投信株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ投信株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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