

【表紙】

| | |
|------------|------------------------------|
| 【提出書類】 | 有価証券報告書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長 |
| 【提出日】 | 平成26年4月16日 |
| 【計算期間】 | 第6期（自平成25年1月18日 至平成26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、一般社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

商品分類表

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

属性区分表

| 投資対象資産 | 決算頻度 | 投資対象地域 | 投資形態 | 為替 ヘッジ | 対象 インデックス | 特殊型 |
|--|----------------------------------|---|----------------------|-----------|---|-------------------------------|
| 株式 | 年1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 |
| 一般 大型株 中小型株 | 年2回 年4回 年6回 | 日本 北米 | ファンド・ オブ・ ファンズ | なし | TOPIX | 条件付運用型 |
| 債券 | (隔月) | 欧州 アジア | | | その他 (シティ世界国 債インデックス (除く日本、 円ベース)) | ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型 |
| 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 () | 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 () |
| 不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (債券 一般 クレジット属性 (高格付 債))) | | | | | | |
| 資産複合 () | | | | | | |

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

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

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

商品分類の定義

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

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

属性区分の定義

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

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

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

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

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

ファンドの特色

1

日本を除く世界各国の公社債を実質的な主要投資対象とします。

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

2

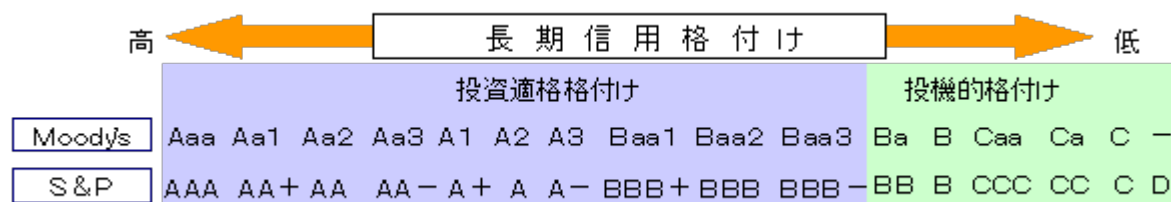
シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)¹に連動する投資成果をめざして運用を行います。

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマーク²とします。

- 1 シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)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(2014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・利息の支払いの確実性の度合いについてランク付けしたものです。これは、アルファベットを使った簡単な記号で表現されており、世界各国、産業別の債券について比較しやすいため、広く利用されています。

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。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

4

原則として為替ヘッジを行いません。

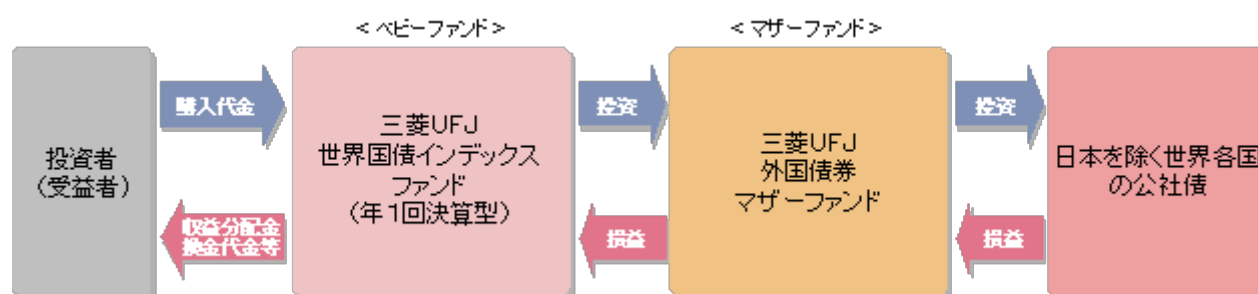
為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

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。

< ファンドの仕組み >

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



< 主な投資制限 >

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

平成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

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

委託会社と関係法人との契約の概要

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

委託会社の概況

・資本金

2,000百万円（平成26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26年1月末現在）

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

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

三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)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ます。)

a. 有価証券先物取引等

b. スワップ取引

c. 金利先渡取引および為替先渡取引

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)は、三菱UFJ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券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

9. 資産の流動化に係る優先出資証券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(シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース))に連動する投資成果を目指して運用を行います。

(運用方法)

投資対象

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

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

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

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

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

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

（投資制限）

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

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

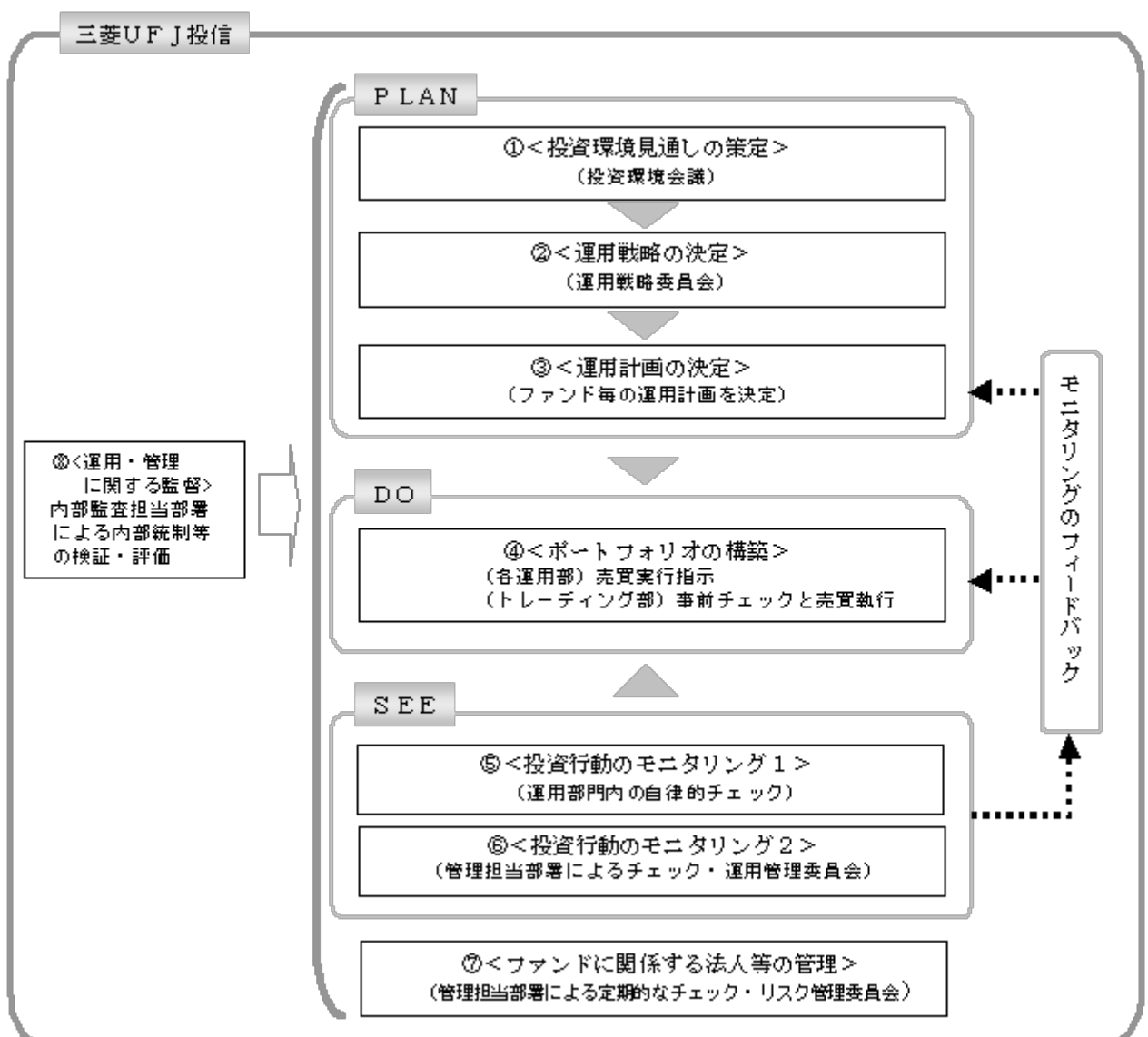
同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

（3）【運用体制】



投資環境見通しの策定

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

運用戦略の決定

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

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

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

投資行動のモニタリング1

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

投資行動のモニタリング2

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

ファンドに係る法人等の管理

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

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署(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26年4月17日現在のものであり、今後変更される可能性があります。

(4)【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

収益分配金額は、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るときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. a. の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

有価証券の貸付

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. a. に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

公社債の空売り

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産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すが、これらの運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

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

投資信託は預貯金と異なります。

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

市場リスク

(価格変動リスク)

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

(為替変動リスク)

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

留意事項

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- 収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- 当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- 当ファンドは、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動することをめざして運用を行いますが、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、債券先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因によりカイ離を生じることがあります。

(2) 投資リスクに対する管理体制

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

各投資リスクに関する管理体制は以下の通りです。

市場リスク

(価格変動リスク・為替変動リスク)

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

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

信用リスク

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

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

流動性リスク

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込手数料はかかりません。

(2)【換金(解約)手数料】

解約手数料はかかりません。

換金の詳細については販売会社にご確認ください。

(3)【信託報酬等】

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

信託財産の純資産総額 × 年0.648% (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0.3348% (税抜 年0.31%) | 年0.2592% (税抜 年0.24%) | 年0.054% (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】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

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

1. 収益分配金の課税

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

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

2. 解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

個別元本について

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

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

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

収益分配金について

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

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

上記は平成26年1月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成26年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 | 2,887,447,686 | 100.00 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | | 122,737 | 0.00 |
| 純資産総額 | | 2,887,570,423 | 100.00 |

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

平成26年1月31日現在

| 国/地域 | 銘柄 | 種類 | 業種 | 口数 | 上段：帳簿価額 下段：評価額 | | 利率(%) 償還期限 (年/月/日) | 投資 比率 (%) |
|------|-----------------------|---------------|----|---------------|-------------------|--------------------------------|--------------------------|-----------------|
| | | | | | 単価(円) | 金額(円) | | |
| 日本 | 三菱UFJ 外国債券マザー ファンド | 親投資信託 受益証券 | | 1,211,482,624 | 2.4095 2.3834 | 2,919,090,502 2,887,447,686 | | 100.00 |

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

b 全銘柄の種類/業種別投資比率

平成26年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26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) |
| 第4計算期間末日 (平成24年1月17日) | 2,553,676,434 (分配付) 2,550,480,801 (分配落) | 7,991 (分配付) 7,981 (分配落) |
| 第5計算期間末日 (平成25年1月17日) | 3,086,343,717 (分配付) 3,083,220,474 (分配落) | 9,882 (分配付) 9,872 (分配落) |
| 第6計算期間末日 (平成26年1月17日) | 2,884,724,385 (分配付) 2,882,252,430 (分配落) | 11,670 (分配付) 11,660 (分配落) |
| 平成25年1月末日 | 3,114,182,345 | 10,148 |
| 2月末日 | 3,051,785,209 | 10,164 |
| 3月末日 | 3,050,209,264 | 10,287 |
| 4月末日 | 3,214,141,722 | 10,993 |
| 5月末日 | 3,177,604,586 | 11,118 |
| 6月末日 | 3,000,685,384 | 10,641 |
| 7月末日 | 3,006,417,600 | 10,706 |

| | | |
|------------|---------------|--------|
| 8月末日 | 2,999,994,000 | 10,663 |
| 9月末日 | 3,018,979,251 | 10,810 |
| 10月末日 | 3,034,965,027 | 11,076 |
| 11月末日 | 3,035,442,397 | 11,458 |
| 12月末日 | 2,887,634,370 | 11,735 |
| 平成26年 1月末日 | 2,887,570,423 | 11,528 |

【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 |
| 第4計算期間 | 10円 |
| 第5計算期間 | 10円 |
| 第6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 |
| 第4計算期間 | 3.24 |
| 第5計算期間 | 23.81 |
| 第6計算期間 | 18.21 |

(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 |
| 第4計算期間 | 799,209,430 | 497,356,293 | 3,195,633,255 |
| 第5計算期間 | 549,365,972 | 621,755,642 | 3,123,243,585 |
| 第6計算期間 | 619,253,111 | 1,270,541,261 | 2,471,955,435 |

<参考>

「三菱UFJ 外国債券マザーファンド」

(1) 投資状況

平成26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 | 74,556,803,246 | 38.97 |
| | フランス | 19,200,866,386 | 10.04 |
| | イタリア | 19,086,556,960 | 9.98 |
| | ドイツ | 16,937,275,513 | 8.85 |
| | イギリス | 15,126,431,569 | 7.91 |
| | スペイン | 10,182,191,863 | 5.32 |
| | オランダ | 5,409,973,598 | 2.83 |
| | ベルギー | 5,247,809,061 | 2.74 |
| | カナダ | 4,359,696,352 | 2.28 |
| | オーストリア | 3,286,919,420 | 1.72 |
| | オーストラリア | 2,844,184,547 | 1.49 |
| | メキシコ | 1,815,647,857 | 0.95 |
| | アイルランド | 1,585,876,916 | 0.83 |
| | ポーランド | 1,546,364,384 | 0.81 |
| | デンマーク | 1,492,962,200 | 0.78 |

| | | | |
|--|--------------------------|-----------------|--------|
| | フィンランド | 1,295,753,869 | 0.68 |
| | スウェーデン | 1,060,506,391 | 0.55 |
| | マレーシア | 959,098,336 | 0.50 |
| | 南アフリカ | 839,682,497 | 0.44 |
| | スイス | 712,856,736 | 0.37 |
| | シンガポール | 662,172,309 | 0.35 |
| | ノルウェー | 619,079,877 | 0.32 |
| | コール・ローン、その他資産 （負債控除後） | 2,474,527,726 | 1.29 |
| | 純資産総額 | 191,303,237,613 | 100.00 |

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

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成26年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 | 1.75 T-NOTE 230515 | 国債証券 | | 8,700,000.00 | 9,524.83 9,523.3895 | 828,660,732 828,534,888 | 1.750000 2023/05/15 | 0.43 |
| アメリカ | 2.5 T-NOTE 150331 | 国債証券 | | 7,700,000.00 | 10,716.32 10,564.8470 | 825,156,981 813,493,220 | 2.500000 2015/03/31 | 0.43 |
| アメリカ | 2.625 T-NOTE 201115 | 国債証券 | | 7,400,000.00 | 11,164.42 10,637.9740 | 826,167,405 787,210,080 | 2.625000 2020/11/15 | 0.41 |
| アメリカ | 2.5 T-NOTE 150430 | 国債証券 | | 7,200,000.00 | 10,735.61 10,584.5350 | 772,963,969 762,086,524 | 2.500000 2015/04/30 | 0.40 |
| アメリカ | 1.5 T-NOTE 180831 | 国債証券 | | 7,300,000.00 | 10,440.43 10,331.8048 | 762,151,430 754,221,753 | 1.500000 2018/08/31 | 0.39 |
| アメリカ | 2 T-NOTE 230215 | 国債証券 | | 7,700,000.00 | 10,251.77 9,786.1646 | 789,386,757 753,534,680 | 2.000000 2023/02/15 | 0.39 |
| アメリカ | 1.625 T-NOTE 221115 | 国債証券 | | 7,700,000.00 | 10,054.42 9,516.9607 | 774,190,572 732,805,979 | 1.625000 2022/11/15 | 0.38 |
| フランス | 3.75 O.A.T 210425 | 国債証券 | | 4,400,000.00 | 16,428.82 16,003.5288 | 722,868,115 704,155,267 | 3.750000 2021/04/25 | 0.37 |
| アメリカ | 0.375 T-NOTE 160115 | 国債証券 | | 6,700,000.00 | 10,294.03 10,292.8305 | 689,700,407 689,619,645 | 0.375000 2016/01/15 | 0.36 |
| フランス | 3.5 O.A.T 200425 | 国債証券 | | 4,300,000.00 | 16,084.61 15,749.0508 | 691,638,435 677,209,184 | 3.500000 2020/04/25 | 0.35 |
| フランス | 4.25 O.A.T 231025 | 国債証券 | | 4,100,000.00 | 16,968.45 16,502.0268 | 695,706,597 676,583,098 | 4.250000 2023/10/25 | 0.35 |
| アメリカ | 2.125 T-NOTE 150531 | 国債証券 | | 6,400,000.00 | 10,674.93 10,549.5787 | 683,196,120 675,173,040 | 2.125000 2015/05/31 | 0.35 |
| フランス | 3 O.A.T 151025 | 国債証券 | | 4,600,000.00 | 14,907.53 14,619.5868 | 685,746,398 672,500,992 | 3.000000 2015/10/25 | 0.35 |
| アメリカ | 0.25 T-NOTE 150930 | 国債証券 | | 6,500,000.00 | 10,271.08 10,284.7946 | 667,620,544 668,511,648 | 0.250000 2015/09/30 | 0.35 |
| フランス | 4.25 O.A.T 190425 | 国債証券 | | 4,100,000.00 | 16,646.59 16,201.5336 | 682,510,595 664,262,877 | 4.250000 2019/04/25 | 0.35 |
| フランス | 3.75 O.A.T 170425 | 国債証券 | | 4,300,000.00 | 15,724.64 15,401.8452 | 676,159,898 662,279,343 | 3.750000 2017/04/25 | 0.35 |
| アメリカ | 0.875 T-NOTE 180131 | 国債証券 | | 6,500,000.00 | 10,329.79 10,163.0501 | 671,436,729 660,598,259 | 0.875000 2018/01/31 | 0.35 |
| アメリカ | 2.25 T-NOTE 150131 | 国債証券 | | 6,200,000.00 | 10,638.80 10,502.5685 | 659,606,207 651,159,246 | 2.250000 2015/01/31 | 0.34 |
| アメリカ | 0.75 T-NOTE 171231 | 国債証券 | | 6,400,000.00 | 10,280.37 10,130.1028 | 657,943,990 648,326,580 | 0.750000 2017/12/31 | 0.34 |
| アメリカ | 3.625 T-NOTE 200215 | 国債証券 | | 5,700,000.00 | 11,887.53 11,331.0736 | 677,589,221 645,871,198 | 3.625000 2020/02/15 | 0.34 |
| アメリカ | 1.375 T-NOTE 200531 | 国債証券 | | 6,500,000.00 | 9,889.98 9,906.7037 | 642,849,285 643,935,743 | 1.375000 2020/05/31 | 0.34 |
| アメリカ | 1.375 T-NOTE 151130 | 国債証券 | | 6,100,000.00 | 10,559.22 10,487.3002 | 644,112,534 639,725,313 | 1.375000 2015/11/30 | 0.33 |
| アメリカ | 0.375 T-NOTE 150315 | 国債証券 | | 6,200,000.00 | 10,310.50 10,310.5096 | 639,251,595 639,251,595 | 0.375000 2015/03/15 | 0.33 |
| アメリカ | 3.375 T-NOTE 191115 | 国債証券 | | 5,700,000.00 | 11,718.83 11,194.0609 | 667,973,868 638,061,472 | 3.375000 2019/11/15 | 0.33 |
| アメリカ | 1.25 T-NOTE 151031 | 国債証券 | | 6,100,000.00 | 10,521.85 10,459.1744 | 641,833,140 638,009,640 | 1.250000 2015/10/31 | 0.33 |
| フランス | 3.25 O.A.T 211025 | 国債証券 | | 4,100,000.00 | 15,836.30 15,502.2420 | 649,288,625 635,591,922 | 3.250000 2021/10/25 | 0.33 |
| フランス | 5.5 O.A.T 290425 | 国債証券 | | 3,400,000.00 | 19,459.66 18,645.2196 | 661,628,479 633,937,466 | 5.500000 2029/04/25 | 0.33 |
| フランス | 3.5 O.A.T 260425 | 国債証券 | | 4,100,000.00 | 15,910.10 15,340.4916 | 652,314,264 628,960,155 | 3.500000 2026/04/25 | 0.33 |

| | | | | | | | | |
|------|-----------------------|------|--|--------------|--------------------------|----------------------------|------------------------|------|
| イタリア | 6.5 ITALY GOVT 271101 | 国債証券 | | 3,600,000.00 | 17,165.06 17,339.3640 | 617,942,304 624,217,104 | 6.500000 2027/11/01 | 0.33 |
| アメリカ | 0.375 T-NOTE 150415 | 国債証券 | | 6,000,000.00 | 10,310.50 10,311.3131 | 618,630,576 618,678,791 | 0.375000 2015/04/15 | 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26年1月31日現在

| 種類 / 業種別 | 投資比率 (%) |
|----------|----------|
| 国債証券 | 98.71 |
| 合計 | 98.71 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

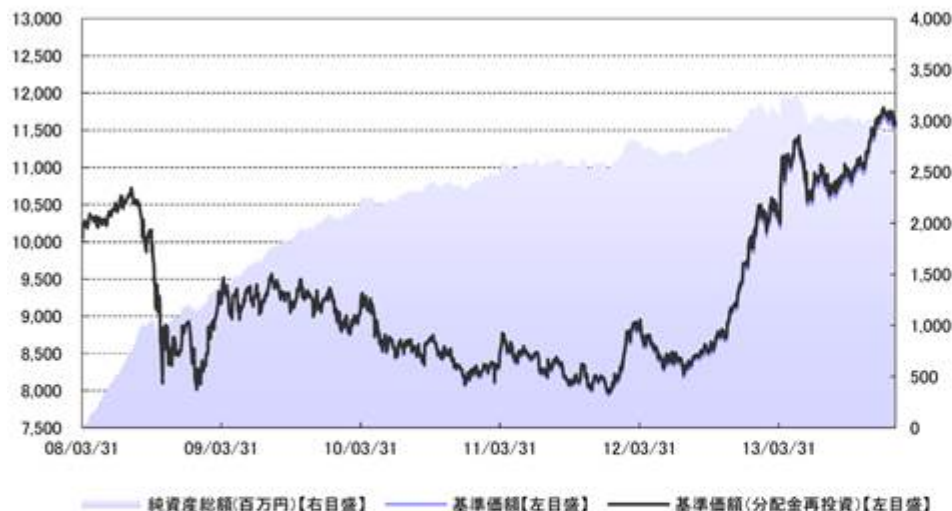
その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

[参考情報]

運用実績

1 基準価額・純資産の推移(設定日～2014年1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)を再投資したもとして計算

2 分配の推移

| | |
|---------|-----|
| 2014年1月 | 10円 |
| 2013年1月 | 10円 |
| 2012年1月 | 10円 |
| 2011年1月 | 10円 |
| 2010年1月 | 10円 |
| 2009年1月 | 10円 |
| 設定来累計 | 60円 |

・分配金は1万口当たり、税引前

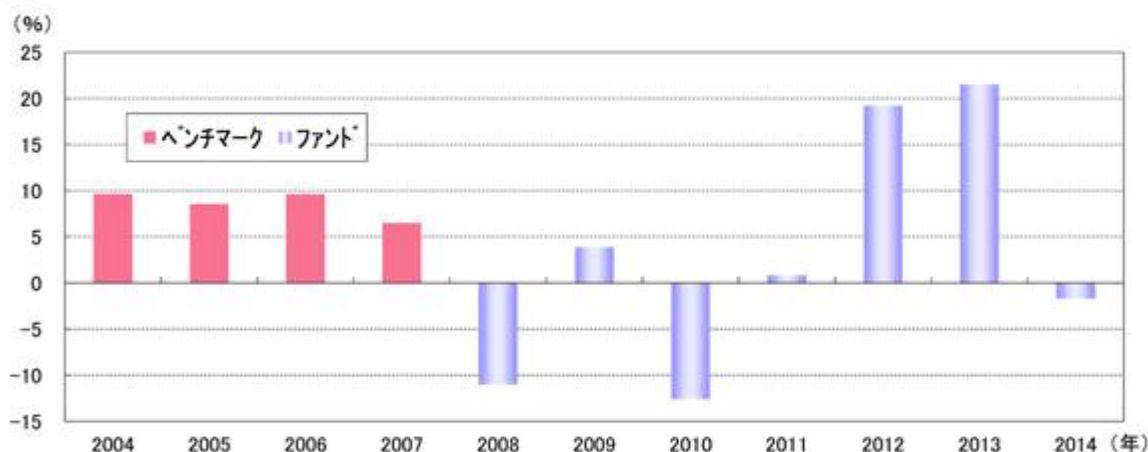
3 主要な資産の状況(2014年1月31日現在)

| 通貨別構成 | 比率 |
|-----------|--------|
| ユーロ | 43.7% |
| アメリカドル | 39.2% |
| イギリスポンド | 8.0% |
| カナダドル | 2.3% |
| オーストラリアドル | 1.5% |
| メキシコペソ | 1.0% |
| ポーランドズロチ | 0.8% |
| デンマーククローネ | 0.8% |
| その他 | 2.7% |
| 合計 | 100.0% |

| | 組入上位銘柄 | 種別 | 国・地域 | 比率 |
|----|---------------------|----|------|------|
| 1 | 1.75 T-NOTE 230515 | 国債 | アメリカ | 0.4% |
| 2 | 2.5 T-NOTE 150331 | 国債 | アメリカ | 0.4% |
| 3 | 2.625 T-NOTE 201115 | 国債 | アメリカ | 0.4% |
| 4 | 2.5 T-NOTE 150430 | 国債 | アメリカ | 0.4% |
| 5 | 1.5 T-NOTE 180831 | 国債 | アメリカ | 0.4% |
| 6 | 2 T-NOTE 230215 | 国債 | アメリカ | 0.4% |
| 7 | 1.625 T-NOTE 221115 | 国債 | アメリカ | 0.4% |
| 8 | 3.75 O.A.T 210425 | 国債 | フランス | 0.4% |
| 9 | 0.375 T-NOTE 160115 | 国債 | アメリカ | 0.4% |
| 10 | 3.5 O.A.T 200425 | 国債 | フランス | 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、2014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 http://www.am.mufg.jp/ |
| 申込手数料 | ありません。 |
| 申込方法 | 取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。 取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。 なお、申込みには分配金受取りコース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があり、分配金再投資コース（累積投資コース）を選択する場合には、取得申込者と販売会社との間で別に定める累積投資契約（販売会社によっては別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を使用する場合があります、この場合は当該別の名称に読み替えます。）を締結するものとします。申込みコースの取扱いは販売会社により異なる場合がありますので、販売会社にご確認ください。 取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。 |
| 申込受付時間 | 原則、午後3時までに受け付けた取得申込み（当該申込みの受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを）を当日の申込みとします。当該時刻を過ぎたの申込みは、翌営業日に受け付けたものとして取り扱います。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に取得申込みを締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。 |
| その他 | 金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みを取り消すことがあります。 |

2【換金（解約）手続等】

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

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

換金の詳細については販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

(2)【保管】

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

(3) 【信託期間】

| | |
|------|---|
| 信託期間 | 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発送します。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、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。 http://www.am.mufg.jp/ なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。 |

4【受益者の権利等】

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

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(平成25年1月18日から平成26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5期 [平成25年1月17日現在] | 第6期 [平成26年1月17日現在] |
|-----------------|----------------------------|----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 15,940,763 | 15,308,722 |
| 親投資信託受益証券 | 3,082,804,204 | 2,881,874,418 |
| 未収入金 | 14,620,100 | - |
| 未収利息 | 36 | 24 |
| 流動資産合計 | 3,113,365,103 | 2,897,183,164 |
| 資産合計 | 3,113,365,103 | 2,897,183,164 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | 3,123,243 | 2,471,955 |
| 未払解約金 | 17,979,130 | 2,888,887 |
| 未払受託者報酬 | 749,039 | 792,739 |
| 未払委託者報酬 | 8,239,348 | 8,720,136 |
| その他未払費用 | 53,869 | 57,017 |
| 流動負債合計 | 30,144,629 | 14,930,734 |
| 負債合計 | 30,144,629 | 14,930,734 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ₁ 3,123,243,585 | ₁ 2,471,955,435 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | ₂ 40,023,111 | ₂ 410,296,995 |
| (分配準備積立金) | 290,710,359 | 575,455,558 |
| 元本等合計 | 3,083,220,474 | 2,882,252,430 |
| 純資産合計 | 3,083,220,474 | 2,882,252,430 |
| 負債純資産合計 | 3,113,365,103 | 2,897,183,164 |

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第 5 期 自 平成24年 1月18日 至 平成25年 1月17日 | 第 6 期 自 平成25年 1月18日 至 平成26年 1月17日 |
|-------------------------|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 5,558 | 6,401 |
| 有価証券売買等損益 | 628,704,726 | 534,689,914 |
| 営業収益合計 | 628,710,284 | 534,696,315 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 1,456,364 | 1,606,408 |
| 委託者報酬 | 16,019,864 | 17,670,397 |
| その他費用 | 104,732 | 115,539 |
| 営業費用合計 | 17,580,960 | 19,392,344 |
| 営業利益 | 611,129,324 | 515,303,971 |
| 経常利益 | 611,129,324 | 515,303,971 |
| 当期純利益 | 611,129,324 | 515,303,971 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額 | 52,371,158 | 121,964,797 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 645,152,454 | 40,023,111 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 122,453,656 | 59,452,887 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 122,453,656 | 5,292,124 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | 54,160,763 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 72,959,236 | - |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 72,959,236 | - |
| 分配金 | 1 3,123,243 | 1 2,471,955 |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 40,023,111 | 410,296,995 |

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|-------------------|---|
| 1 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。 |
|-------------------|---|

(貸借対照表に関する注記)

| | 第 5 期 [平成25年1月17日現在] | 第 6 期 [平成26年1月17日現在] |
|--|---------------------------|---------------------------|
| 1 期首元本額 | 3,195,633,255円 | 3,123,243,585円 |
| 期中追加設定元本額 | 549,365,972円 | 619,253,111円 |
| 期中一部解約元本額 | 621,755,642円 | 1,270,541,261円 |
| 2 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。 | 40,023,111円 | |
| 3 受益権の総数 | 3,123,243,585口 | 2,471,955,435口 |
| 4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.9872円 (9,872円) | 1.1660円 (11,660円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 5 期 (自 平成24年1月18日 至 平成25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 | 80,119,212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 | 68,883,463円 |
| 収益調整金額 | C | 127,861,795円 |
| 分配準備積立金額 | D | 144,830,927円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 421,695,397円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 3,123,243,585口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 1,350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 | 3,123,243円 |

第 6 期 (自 平成25年1月18日 至 平成26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 | 74,850,478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 | 318,488,696円 |
| 収益調整金額 | C | 147,268,440円 |
| 分配準備積立金額 | D | 184,588,339円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 725,195,953円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 2,471,955,435口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 2,933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 | 2,471,955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 5 期 (自 平成24年 1月18日 至 平成25年 1月17日) | 第 6 期 (自 平成25年 1月18日 至 平成26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。 | 同 左 |
| 2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 親投資信託受益証券は、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 | 同 左 |

| | | |
|------------------|--|----------------|
| 3 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>また、親投資信託受益証券に係るデリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> | 同 左 同 左 |
|------------------|--|----------------|

2 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分 | 第 5 期 [平成25年1月17日現在] | 第 6 期 [平成26年1月17日現在] |
|---------------------------|--|---------------------------|
| 1 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。 | 同 左 |
| 2 時価の算定方法 | <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> | 同 左 同 左 同 左 |
| 3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同 左 |

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

| 種 類 | 第 5 期 [平成25年1月17日現在] | 第 6 期 [平成26年1月17日現在] |
|-----------|---------------------------|---------------------------|
| | 当計算期間の損益に含まれた評価差額(円) | 当計算期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 親投資信託受益証券 | 601,708,353 | 451,701,547 |
| 合計 | 601,708,353 | 451,701,547 |

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

| 種 類 | 銘 柄 | 口数 | 評 価 額 | 備 考 |
|-----------|-------------------|---------------|---------------|-----|
| 親投資信託受益証券 | 三菱UFJ 外国債券マザーファンド | 1,195,798,514 | 2,881,874,418 | |
| | 親投資信託受益証券 小計 | 1,195,798,514 | 2,881,874,418 | |
| 合計 | | 1,195,798,514 | 2,881,874,418 | |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

<参考>

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

「三菱UFJ」外国債券マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

| | [平成25年1月17日現在] | [平成26年1月17日現在] |
|-------------|------------------|------------------|
| | 金額(円) | 金額(円) |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 294,518,224 | 254,595,177 |
| コール・ローン | 99,269,787 | 277,392,458 |
| 国債証券 | 222,749,613,047 | 193,999,769,664 |
| 派生商品評価勘定 | 31,970 | 1,325,914 |
| 未収入金 | 105,729,446 | 415,664,979 |
| 未収利息 | 2,330,648,529 | 2,046,482,953 |
| 前払費用 | 39,980,357 | 40,617,971 |
| 流動資産合計 | 225,619,791,360 | 197,035,849,116 |
| 資産合計 | 225,619,791,360 | 197,035,849,116 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 113,630 | 4,028 |
| 未払解約金 | 126,610,787 | 600,511,579 |
| 流動負債合計 | 126,724,417 | 600,515,607 |
| 負債合計 | 126,724,417 | 600,515,607 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 111,312,539,737 | 81,509,949,811 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 114,180,527,206 | 114,925,383,698 |
| 元本等合計 | 225,493,066,943 | 196,435,333,509 |
| 純資産合計 | 225,493,066,943 | 196,435,333,509 |
| 負債純資産合計 | 225,619,791,360 | 197,035,849,116 |

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| | [平成25年1月17日現在] | [平成26年1月17日現在] |
|-------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| 1 期首 | | |
| 期首元本額 | 平成24年1月18日 122,540,355,973円 | 平成25年1月18日 111,312,539,737円 |
| 期首からの追加設定元本額 | 3,492,875,106円 | 4,613,478,269円 |
| 期首からの一部解約元本額 | 14,720,691,342円 | 34,416,068,195円 |
| 元本の内訳* | | |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型) | 134,224,710円 | 127,815,936円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型) | 205,706,825円 | 225,603,398円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型) | 123,747,145円 | 145,595,280円 |
| 三菱UFJ 外国債券オープン | 2,901,366,015円 | 1,979,429,724円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金) | 727,353,114円 | 743,079,828円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金) | 1,847,920,998円 | 1,996,665,324円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金) | 1,091,522,673円 | 1,305,561,985円 |
| 三菱UFJ 財産分散ファンド(毎月決算型) | 1,477,918,193円 | 1,142,021,685円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型) | 1,192,528,970円 | 914,697,231円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型) | 159,324,815円 | 112,519,689円 |
| FPバランスファンド(安定型) | 63,625,233円 | 66,616,673円 |
| FPバランスファンド(安定成長型) | 107,759,559円 | 81,264,554円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 235,931円 | 6,041,887円 |
| 三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金) | 1,889,305,728円 | 1,929,691,600円 |
| 三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型) | 793,097,147円 | 539,528,533円 |

| | | |
|---------------------------------------|----------------------|----------------------|
| 三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型) | 1,521,771,253円 | 1,195,798,514円 |
| 三菱UFJ 外国債券ファンドVA(適格機関投資家限定) | 90,233,419,495円 | 67,029,765,272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) | 2,660,133円 | 269,498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) | 10,515,452円 | 1,634,299円 |
| 三菱UFJ 外国債券ファンドVA2(適格機関投資家限定) | 347,370,317円 | 202,319,437円 |
| MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定) | 6,463,445,033円 | 1,764,029,464円 |
| ワールドバランス2006 | 17,720,998円 | |
| (合計) | 111,312,539,737円 | 81,509,949,811円 |
| 2 受益権の総数 | 111,312,539,737口 | 81,509,949,811口 |
| 3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 2.0258円 (20,258円) | 2.4100円 (24,100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24年1月18日 至平成25年1月17日) | (自平成25年1月18日 至平成26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。 | 同 左 |
| 2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、公社債に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。 | 同 左 |
| 3 金融商品に係るリスク管理体制 | 当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。 | 同 左 |

2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | [平成25年1月17日現在] | [平成26年1月17日現在] |
|---------------------------|---|-------------------|
| 1 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。 | 同 左 |
| 2 時価の算定方法 | 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引等関係に関する注記)に記載しております。 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 | 同 左 同 左 同 左 |
| 3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。 | 同 左 |

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | [平成25年1月17日現在] | [平成26年1月17日現在] |
|------|--------------------|--------------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券 | 2,713,870,927 | 5,337,078,982 |
| 合計 | 2,713,870,927 | 5,337,078,982 |

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

| 区分 | 種類 | [平成25年1月17日現在] | | |
|-----------|--------------|------------------|------------|-------------|
| | | 契約額等(円) うち1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 売建 | | | |
| | アメリカドル | 91,280,200 | 91,319,800 | 39,600 |
| | オーストラリアドル | 7,479,120 | 7,480,000 | 880 |
| | イギリスポンド | 18,449,600 | 18,448,300 | 1,300 |

| | | | |
|------------|-------------|-------------|--------|
| マレーシアリングット | 7,033,200 | 7,058,400 | 25,200 |
| スウェーデンクローネ | 5,864,770 | 5,860,900 | 3,870 |
| デンマーククローネ | 5,523,350 | 5,533,500 | 10,150 |
| メキシコペソ | 7,031,000 | 7,010,000 | 21,000 |
| ユーロ | 91,969,000 | 92,001,000 | 32,000 |
| 合 計 | 234,630,240 | 234,711,900 | 81,660 |

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

(注) 時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

| 通 貨 | | 券面総額 | 評 価 額 | 備 考 |
|--------|---------------------|--------------|--------------|-----|
| 種 類 | 銘 柄 | | | |
| アメリカドル | | | | |
| 国債証券 | 0.25 T-NOTE 150115 | 5,200,000.00 | 5,205,890.62 | |
| | 0.25 T-NOTE 150215 | 6,000,000.00 | 6,005,859.37 | |
| | 0.25 T-NOTE 150515 | 5,500,000.00 | 5,504,082.02 | |
| | 0.25 T-NOTE 150531 | 5,000,000.00 | 5,002,929.68 | |
| | 0.25 T-NOTE 150715 | 4,700,000.00 | 4,699,816.40 | |
| | 0.25 T-NOTE 150731 | 5,500,000.00 | 5,499,785.15 | |
| | 0.25 T-NOTE 150815 | 5,000,000.00 | 4,997,851.56 | |
| | 0.25 T-NOTE 150915 | 5,000,000.00 | 4,996,289.06 | |
| | 0.25 T-NOTE 150930 | 6,500,000.00 | 6,495,175.77 | |
| | 0.25 T-NOTE 151015 | 4,500,000.00 | 4,494,023.43 | |
| | 0.25 T-NOTE 151130 | 4,800,000.00 | 4,790,625.00 | |
| | 0.25 T-NOTE 151215 | 3,000,000.00 | 2,993,085.93 | |
| | 0.25 T-NOTE 160415 | 4,800,000.00 | 4,774,312.49 | |
| | 0.25 T-NOTE 160515 | 5,000,000.00 | 4,968,945.31 | |
| | 0.375 T-NOTE 150315 | 6,200,000.00 | 6,214,046.87 | |
| | 0.375 T-NOTE 150415 | 6,000,000.00 | 6,014,296.87 | |
| | 0.375 T-NOTE 150615 | 5,500,000.00 | 5,512,031.25 | |
| | 0.375 T-NOTE 151115 | 4,700,000.00 | 4,702,753.90 | |
| | 0.375 T-NOTE 160115 | 6,700,000.00 | 6,696,597.65 | |

| | | |
|---------------------|--------------|--------------|
| 0.375 T-NOTE 160215 | 6,200,000.00 | 6,193,460.93 |
| 0.375 T-NOTE 160315 | 5,500,000.00 | 5,490,332.02 |
| 0.5 T-NOTE 160615 | 4,500,000.00 | 4,494,199.21 |
| 0.5 T-NOTE 170731 | 2,500,000.00 | 2,450,585.93 |
| 0.625 T-NOTE 160715 | 4,000,000.00 | 4,003,281.24 |
| 0.625 T-NOTE 160815 | 4,500,000.00 | 4,500,175.77 |
| 0.625 T-NOTE 161015 | 3,000,000.00 | 2,994,492.18 |
| 0.625 T-NOTE 161115 | 3,000,000.00 | 2,991,914.06 |
| 0.625 T-NOTE 170531 | 4,000,000.00 | 3,951,406.24 |
| 0.625 T-NOTE 170831 | 5,000,000.00 | 4,913,476.56 |
| 0.625 T-NOTE 170930 | 5,000,000.00 | 4,905,078.12 |
| 0.75 T-NOTE 170630 | 4,300,000.00 | 4,259,351.56 |
| 0.75 T-NOTE 171031 | 6,000,000.00 | 5,902,968.75 |
| 0.75 T-NOTE 171231 | 6,400,000.00 | 6,273,500.00 |
| 0.75 T-NOTE 180228 | 1,500,000.00 | 1,464,960.93 |
| 0.75 T-NOTE 180331 | 5,000,000.00 | 4,873,828.12 |
| 0.875 T-NOTE 160915 | 3,900,000.00 | 3,922,699.21 |
| 0.875 T-NOTE 161130 | 4,200,000.00 | 4,214,273.43 |
| 0.875 T-NOTE 161231 | 4,900,000.00 | 4,911,867.18 |
| 0.875 T-NOTE 170131 | 4,000,000.00 | 4,005,156.24 |
| 0.875 T-NOTE 170228 | 4,100,000.00 | 4,100,160.15 |
| 0.875 T-NOTE 170430 | 4,600,000.00 | 4,588,679.68 |
| 0.875 T-NOTE 180131 | 6,500,000.00 | 6,391,328.12 |
| 0.875 T-NOTE 190731 | 2,700,000.00 | 2,560,148.43 |
| 1 T-NOTE 160831 | 3,700,000.00 | 3,735,121.09 |
| 1 T-NOTE 160930 | 4,500,000.00 | 4,539,023.43 |
| 1 T-NOTE 161031 | 3,300,000.00 | 3,325,523.43 |
| 1 T-NOTE 170331 | 4,000,000.00 | 4,010,781.24 |
| 1 T-NOTE 190831 | 1,000,000.00 | 952,109.37 |
| 1 T-NOTE 190930 | 1,000,000.00 | 950,742.18 |
| 1.125 T-NOTE 190531 | 2,400,000.00 | 2,316,562.50 |
| 1.125 T-NOTE 191231 | 4,700,000.00 | 4,471,609.37 |
| 1.125 T-NOTE 200331 | 4,000,000.00 | 3,778,125.00 |
| 1.125 T-NOTE 200430 | 3,000,000.00 | 2,826,796.87 |
| 1.25 T-NOTE 150831 | 5,700,000.00 | 5,789,730.46 |
| 1.25 T-NOTE 150930 | 4,700,000.00 | 4,774,722.65 |
| 1.25 T-NOTE 151031 | 6,100,000.00 | 6,198,410.15 |
| 1.25 T-NOTE 190131 | 3,000,000.00 | 2,939,765.62 |
| 1.25 T-NOTE 190430 | 1,300,000.00 | 1,266,179.68 |
| 1.25 T-NOTE 191031 | 5,000,000.00 | 4,813,671.87 |
| 1.25 T-NOTE 200229 | 2,900,000.00 | 2,766,101.56 |
| 1.375 T-NOTE 151130 | 6,100,000.00 | 6,214,136.71 |
| 1.375 T-NOTE 180630 | 3,000,000.00 | 2,987,460.93 |
| 1.375 T-NOTE 180731 | 2,200,000.00 | 2,187,796.87 |
| 1.375 T-NOTE 180930 | 4,000,000.00 | 3,965,312.49 |
| 1.375 T-NOTE 181130 | 1,600,000.00 | 1,582,875.00 |
| 1.375 T-NOTE 181231 | 2,200,000.00 | 2,173,015.62 |
| 1.375 T-NOTE 190228 | 1,000,000.00 | 984,414.06 |
| 1.375 T-NOTE 200131 | 4,200,000.00 | 4,047,257.81 |
| 1.375 T-NOTE 200531 | 6,500,000.00 | 6,208,515.62 |
| 1.5 T-NOTE 160630 | 4,200,000.00 | 4,294,171.87 |
| 1.5 T-NOTE 160731 | 4,600,000.00 | 4,704,039.06 |
| 1.5 T-NOTE 180831 | 7,300,000.00 | 7,289,164.06 |
| 1.5 T-NOTE 190331 | 2,000,000.00 | 1,977,265.62 |
| 1.625 T-NOTE 220815 | 5,900,000.00 | 5,428,000.00 |
| 1.625 T-NOTE 221115 | 7,700,000.00 | 7,041,589.83 |
| 1.75 T-NOTE 150731 | 5,700,000.00 | 5,829,363.27 |
| 1.75 T-NOTE 160531 | 3,700,000.00 | 3,804,785.15 |
| 1.75 T-NOTE 181031 | 1,600,000.00 | 1,613,000.00 |
| 1.75 T-NOTE 201031 | 1,800,000.00 | 1,742,765.62 |
| 1.75 T-NOTE 220515 | 5,500,000.00 | 5,144,218.75 |
| 1.75 T-NOTE 230515 | 9,200,000.00 | 8,411,531.25 |
| 1.875 T-NOTE 150630 | 5,700,000.00 | 5,834,929.68 |
| 1.875 T-NOTE 170831 | 3,700,000.00 | 3,800,882.81 |
| 1.875 T-NOTE 170930 | 4,200,000.00 | 4,312,875.00 |
| 1.875 T-NOTE 171031 | 5,100,000.00 | 5,234,273.43 |
| 2 T-NOTE 160131 | 4,000,000.00 | 4,128,750.00 |

| | | | |
|---------------------|--------------|--------------|--|
| 2 T-NOTE 160430 | 3,800,000.00 | 3,929,289.06 | |
| 2 T-NOTE 200731 | 3,100,000.00 | 3,069,484.37 | |
| 2 T-NOTE 201130 | 3,500,000.00 | 3,439,023.43 | |
| 2 T-NOTE 211115 | 6,100,000.00 | 5,885,785.15 | |
| 2 T-NOTE 220215 | 4,200,000.00 | 4,029,375.00 | |
| 2 T-NOTE 230215 | 7,700,000.00 | 7,239,203.12 | |
| 2.125 T-NOTE 150531 | 6,400,000.00 | 6,567,749.99 | |
| 2.125 T-NOTE 151231 | 5,400,000.00 | 5,581,406.25 | |
| 2.125 T-NOTE 160229 | 2,600,000.00 | 2,692,320.31 | |
| 2.125 T-NOTE 200831 | 4,500,000.00 | 4,479,257.81 | |
| 2.125 T-NOTE 210815 | 5,400,000.00 | 5,284,828.12 | |
| 2.25 T-NOTE 150131 | 6,200,000.00 | 6,334,898.43 | |
| 2.25 T-NOTE 160331 | 3,700,000.00 | 3,844,097.65 | |
| 2.25 T-NOTE 171130 | 2,900,000.00 | 3,014,187.50 | |
| 2.25 T-NOTE 180731 | 1,500,000.00 | 1,550,566.40 | |
| 2.375 T-NOTE 150228 | 5,000,000.00 | 5,122,851.56 | |
| 2.375 T-NOTE 160331 | 1,900,000.00 | 1,979,414.06 | |
| 2.375 T-NOTE 170731 | 3,900,000.00 | 4,076,414.06 | |
| 2.375 T-NOTE 180531 | 2,000,000.00 | 2,080,625.00 | |
| 2.375 T-NOTE 180630 | 2,900,000.00 | 3,016,226.56 | |
| 2.5 T-NOTE 150331 | 7,700,000.00 | 7,913,253.90 | |
| 2.5 T-NOTE 150430 | 7,200,000.00 | 7,413,187.50 | |
| 2.5 T-NOTE 170630 | 2,500,000.00 | 2,625,000.00 | |
| 2.5 T-NOTE 230815 | 2,700,000.00 | 2,629,546.87 | |
| 2.625 T-NOTE 141231 | 4,200,000.00 | 4,299,257.81 | |
| 2.625 T-NOTE 160229 | 2,200,000.00 | 2,301,664.06 | |
| 2.625 T-NOTE 160430 | 2,100,000.00 | 2,200,816.40 | |
| 2.625 T-NOTE 180131 | 1,800,000.00 | 1,896,046.87 | |
| 2.625 T-NOTE 180430 | 1,700,000.00 | 1,788,054.68 | |
| 2.625 T-NOTE 200815 | 5,500,000.00 | 5,658,554.68 | |
| 2.625 T-NOTE 201115 | 7,400,000.00 | 7,584,421.87 | |
| 2.75 T-BOND 420815 | 6,200,000.00 | 5,077,703.12 | |
| 2.75 T-BOND 421115 | 6,800,000.00 | 5,555,812.50 | |
| 2.75 T-NOTE 161130 | 2,600,000.00 | 2,747,265.62 | |
| 2.75 T-NOTE 170531 | 2,700,000.00 | 2,858,835.93 | |
| 2.75 T-NOTE 171231 | 2,000,000.00 | 2,117,187.50 | |
| 2.75 T-NOTE 180228 | 2,200,000.00 | 2,327,015.62 | |
| 2.75 T-NOTE 190215 | 3,400,000.00 | 3,578,234.37 | |
| 2.75 T-NOTE 231115 | 3,800,000.00 | 3,768,828.12 | |
| 2.875 T-BOND 430515 | 2,600,000.00 | 2,175,671.87 | |
| 2.875 T-NOTE 180331 | 2,800,000.00 | 2,974,562.50 | |
| 3 T-BOND 420515 | 3,600,000.00 | 3,117,656.25 | |
| 3 T-NOTE 160831 | 3,000,000.00 | 3,185,039.06 | |
| 3 T-NOTE 160930 | 3,300,000.00 | 3,505,863.27 | |
| 3 T-NOTE 170228 | 2,800,000.00 | 2,983,421.87 | |
| 3.125 T-BOND 411115 | 4,600,000.00 | 4,100,468.75 | |
| 3.125 T-BOND 420215 | 6,200,000.00 | 5,517,515.62 | |
| 3.125 T-BOND 430215 | 4,400,000.00 | 3,888,843.75 | |
| 3.125 T-NOTE 161031 | 3,400,000.00 | 3,625,648.43 | |
| 3.125 T-NOTE 170131 | 3,200,000.00 | 3,420,250.00 | |
| 3.125 T-NOTE 170430 | 2,900,000.00 | 3,104,585.93 | |
| 3.125 T-NOTE 190515 | 4,000,000.00 | 4,279,218.74 | |
| 3.125 T-NOTE 210515 | 3,400,000.00 | 3,576,640.62 | |
| 3.25 T-NOTE 160531 | 1,900,000.00 | 2,021,496.09 | |
| 3.25 T-NOTE 160630 | 2,400,000.00 | 2,556,843.74 | |
| 3.25 T-NOTE 160731 | 3,000,000.00 | 3,201,328.12 | |
| 3.25 T-NOTE 161231 | 2,700,000.00 | 2,895,117.18 | |
| 3.25 T-NOTE 170331 | 3,200,000.00 | 3,438,750.00 | |
| 3.375 T-NOTE 191115 | 5,700,000.00 | 6,166,242.18 | |
| 3.5 T-BOND 390215 | 1,700,000.00 | 1,648,335.93 | |
| 3.5 T-NOTE 180215 | 4,300,000.00 | 4,675,914.06 | |
| 3.5 T-NOTE 200515 | 5,100,000.00 | 5,540,074.21 | |
| 3.625 T-NOTE 190815 | 3,500,000.00 | 3,834,140.62 | |
| 3.625 T-NOTE 200215 | 5,700,000.00 | 6,239,273.43 | |
| 3.625 T-NOTE 210215 | 5,400,000.00 | 5,876,718.75 | |
| 3.75 T-BOND 410815 | 3,100,000.00 | 3,114,046.87 | |
| 3.75 T-NOTE 181115 | 3,900,000.00 | 4,294,265.62 | |

| | | | |
|----------------------|----------------|------------------------------------|--|
| 3.875 T-BOND 400815 | 2,500,000.00 | 2,574,414.06 | |
| 3.875 T-NOTE 180515 | 2,200,000.00 | 2,430,656.25 | |
| 4 T-NOTE 150215 | 6,600,000.00 | 6,872,507.80 | |
| 4 T-NOTE 180815 | 2,300,000.00 | 2,558,390.62 | |
| 4.125 T-NOTE 150515 | 4,100,000.00 | 4,312,527.34 | |
| 4.25 T-BOND 390515 | 1,500,000.00 | 1,645,546.87 | |
| 4.25 T-BOND 401115 | 2,800,000.00 | 3,066,437.50 | |
| 4.25 T-NOTE 150815 | 4,200,000.00 | 4,462,335.93 | |
| 4.25 T-NOTE 171115 | 3,200,000.00 | 3,565,500.00 | |
| 4.375 T-BOND 380215 | 800,000.00 | 893,875.00 | |
| 4.375 T-BOND 391115 | 2,300,000.00 | 2,570,250.00 | |
| 4.375 T-BOND 400515 | 2,600,000.00 | 2,905,296.87 | |
| 4.375 T-BOND 410515 | 2,900,000.00 | 3,237,804.68 | |
| 4.5 T-BOND 360215 | 1,400,000.00 | 1,596,765.62 | |
| 4.5 T-BOND 380515 | 700,000.00 | 797,234.37 | |
| 4.5 T-BOND 390815 | 2,100,000.00 | 2,393,179.68 | |
| 4.5 T-NOTE 151115 | 3,700,000.00 | 3,979,667.96 | |
| 4.5 T-NOTE 160215 | 1,900,000.00 | 2,060,832.03 | |
| 4.5 T-NOTE 170515 | 1,500,000.00 | 1,673,261.71 | |
| 4.625 T-BOND 400215 | 2,700,000.00 | 3,134,953.12 | |
| 4.625 T-NOTE 161115 | 2,300,000.00 | 2,550,125.00 | |
| 4.625 T-NOTE 170215 | 2,100,000.00 | 2,340,843.75 | |
| 4.75 T-BOND 410215 | 2,600,000.00 | 3,077,343.75 | |
| 4.75 T-NOTE 170815 | 3,900,000.00 | 4,406,085.93 | |
| 4.875 T-NOTE 160815 | 1,700,000.00 | 1,885,804.68 | |
| 5 T-BOND 370515 | 800,000.00 | 976,250.00 | |
| 5.125 T-NOTE 160515 | 2,500,000.00 | 2,766,503.90 | |
| 5.25 T-BOND 281115 | 1,100,000.00 | 1,350,164.06 | |
| 5.25 T-BOND 290215 | 800,000.00 | 982,312.50 | |
| 5.375 T-BOND 310215 | 1,600,000.00 | 2,003,500.00 | |
| 5.5 T-BOND 280815 | 700,000.00 | 879,429.68 | |
| 6 T-BOND 260215 | 900,000.00 | 1,166,976.56 | |
| 6.125 T-BOND 271115 | 1,400,000.00 | 1,853,687.50 | |
| 6.25 T-BOND 230815 | 1,800,000.00 | 2,338,804.68 | |
| 6.25 T-BOND 300515 | 1,100,000.00 | 1,499,093.75 | |
| 6.5 T-BOND 261115 | 700,000.00 | 950,031.25 | |
| 7.25 T-BOND 160515 | 700,000.00 | 809,156.25 | |
| 7.5 T-BOND 161115 | 1,500,000.00 | 1,784,589.84 | |
| 8 T-BOND 211115 | 900,000.00 | 1,260,070.31 | |
| 8.125 T-BOND 190815 | 500,000.00 | 668,476.56 | |
| 8.75 T-BOND 170515 | 900,000.00 | 1,129,921.87 | |
| 8.75 T-BOND 200815 | 700,000.00 | 988,039.06 | |
| 8.875 T-BOND 190215 | 1,100,000.00 | 1,490,757.81 | |
| 国債証券 小計 | 721,400,000.00 | 732,728,120.18 (76,496,815,746) | |
| アメリカドル 小計 | 721,400,000.00 | 732,728,120.18 (76,496,815,746) | |
| カナダドル | | | |
| 国債証券 | | | |
| 1 CAN GOVT 150201 | 1,900,000.00 | 1,900,988.00 | |
| 1 CAN GOVT 151101 | 700,000.00 | 699,727.00 | |
| 1 CAN GOVT 160801 | 1,100,000.00 | 1,096,491.00 | |
| 1.25 CAN GOVT 160201 | 900,000.00 | 903,798.00 | |
| 1.25 CAN GOVT 180301 | 1,800,000.00 | 1,776,366.00 | |
| 1.25 CAN GOVT 180901 | 1,000,000.00 | 979,100.00 | |
| 1.5 CAN GOVT 150801 | 1,500,000.00 | 1,511,610.00 | |
| 1.5 CAN GOVT 170301 | 1,400,000.00 | 1,410,612.00 | |
| 1.5 CAN GOVT 170901 | 1,100,000.00 | 1,103,014.00 | |
| 1.5 CAN GOVT 230601 | 1,700,000.00 | 1,554,905.00 | |
| 1.75 CAN GOVT 190301 | 200,000.00 | 199,212.00 | |
| 2 CAN GOVT 160601 | 1,700,000.00 | 1,736,788.00 | |
| 2.5 CAN GOVT 150601 | 1,300,000.00 | 1,326,793.00 | |
| 2.5 CAN GOVT 240601 | 1,000,000.00 | 987,180.00 | |
| 2.75 CAN GOVT 160901 | 1,700,000.00 | 1,769,904.00 | |
| 2.75 CAN GOVT 220601 | 1,600,000.00 | 1,643,552.00 | |
| 3 CAN GOVT 151201 | 2,200,000.00 | 2,279,684.00 | |
| 3.25 CAN GOVT 210601 | 1,400,000.00 | 1,504,454.00 | |
| 3.5 CAN GOVT 200601 | 1,600,000.00 | 1,742,800.00 | |

| | | | | |
|------|-----------------------|---------------|----------------------------------|--|
| | 3.5 CAN GOVT 451201 | 1,400,000.00 | 1,513,960.00 | |
| | 3.75 CAN GOVT 190601 | 2,300,000.00 | 2,524,250.00 | |
| | 4 CAN GOVT 160601 | 1,300,000.00 | 1,388,686.00 | |
| | 4 CAN GOVT 170601 | 1,700,000.00 | 1,850,739.00 | |
| | 4 CAN GOVT 410601 | 2,400,000.00 | 2,802,240.00 | |
| | 4.25 CAN GOVT 180601 | 1,500,000.00 | 1,668,030.00 | |
| | 4.5 CAN GOVT 150601 | 2,200,000.00 | 2,304,764.00 | |
| | 5 CAN GOVT 370601 | 1,700,000.00 | 2,252,874.00 | |
| | 5.75 CAN GOVT 290601 | 1,300,000.00 | 1,763,359.00 | |
| | 5.75 CAN GOVT 330601 | 1,700,000.00 | 2,384,590.00 | |
| | 8 CAN GOVT 270601 | 600,000.00 | 951,042.00 | |
| | 国債証券 小計 | 43,900,000.00 | 47,531,512.00 (4,540,210,026) | |
| | カナダドル 小計 | 43,900,000.00 | 47,531,512.00 (4,540,210,026) | |
| | オーストラリアドル | | | |
| 国債証券 | 2.75 AUST GOVT 240421 | 1,600,000.00 | 1,410,384.00 | |
| | 3.25 AUST GOVT 250421 | 800,000.00 | 727,384.00 | |
| | 3.25 AUST GOVT 290421 | 800,000.00 | 683,296.00 | |
| | 4.25 AUST GOVT 170721 | 2,100,000.00 | 2,184,084.00 | |
| | 4.5 AUST GOVT 200415 | 2,300,000.00 | 2,408,468.00 | |
| | 4.5 AUST GOVT 330421 | 900,000.00 | 870,660.00 | |
| | 4.75 AUST GOVT 151021 | 1,800,000.00 | 1,865,952.00 | |
| | 4.75 AUST GOVT 160615 | 2,800,000.00 | 2,930,200.00 | |
| | 4.75 AUST GOVT 270421 | 1,400,000.00 | 1,445,430.00 | |
| | 5.25 AUST GOVT 190315 | 2,100,000.00 | 2,279,235.00 | |
| | 5.5 AUST GOVT 180121 | 2,400,000.00 | 2,608,728.00 | |
| | 5.5 AUST GOVT 230421 | 2,700,000.00 | 2,992,599.00 | |
| | 5.75 AUST GOVT 210515 | 2,200,000.00 | 2,468,620.00 | |
| | 5.75 AUST GOVT 220715 | 1,900,000.00 | 2,137,861.00 | |
| | 6 AUST GOVT 170215 | 2,400,000.00 | 2,616,624.00 | |
| | 6.25 AUST GOVT 150415 | 1,700,000.00 | 1,777,418.00 | |
| | 国債証券 小計 | 29,900,000.00 | 31,406,943.00 (2,892,893,519) | |
| | オーストラリアドル 小計 | 29,900,000.00 | 31,406,943.00 (2,892,893,519) | |
| | イギリスポンド | | | |
| 国債証券 | 1 GILT 170907 | 3,400,000.00 | 3,360,050.00 | |
| | 1.25 GILT 180722 | 3,600,000.00 | 3,532,860.00 | |
| | 1.75 GILT 170122 | 1,800,000.00 | 1,837,170.00 | |
| | 1.75 GILT 190722 | 300,000.00 | 295,860.00 | |
| | 1.75 GILT 220907 | 3,300,000.00 | 3,070,155.00 | |
| | 2 GILT 160122 | 2,900,000.00 | 2,977,720.00 | |
| | 2.25 GILT 230907 | 2,400,000.00 | 2,287,080.00 | |
| | 2.75 GILT 150122 | 3,100,000.00 | 3,172,230.00 | |
| | 3.25 GILT 440122 | 2,500,000.00 | 2,355,500.00 | |
| | 3.5 GILT 680722 | 1,000,000.00 | 997,050.00 | |
| | 3.75 GILT 190907 | 2,000,000.00 | 2,186,000.00 | |
| | 3.75 GILT 200907 | 2,500,000.00 | 2,734,375.00 | |
| | 3.75 GILT 210907 | 2,500,000.00 | 2,728,500.00 | |
| | 3.75 GILT 520722 | 1,500,000.00 | 1,572,375.00 | |
| | 4 GILT 160907 | 3,000,000.00 | 3,248,400.00 | |
| | 4 GILT 220307 | 1,700,000.00 | 1,885,470.00 | |
| | 4 GILT 600122 | 2,000,000.00 | 2,233,900.00 | |
| | 4.25 GILT 271207 | 1,600,000.00 | 1,791,360.00 | |
| | 4.25 GILT 320607 | 2,500,000.00 | 2,796,625.00 | |
| | 4.25 GILT 360307 | 2,300,000.00 | 2,573,700.00 | |
| | 4.25 GILT 390907 | 1,500,000.00 | 1,685,625.00 | |
| | 4.25 GILT 401207 | 2,200,000.00 | 2,475,990.00 | |
| | 4.25 GILT 461207 | 2,000,000.00 | 2,281,400.00 | |
| | 4.25 GILT 491207 | 1,900,000.00 | 2,188,135.00 | |
| | 4.25 GILT 551207 | 2,000,000.00 | 2,334,900.00 | |
| | 4.5 GILT 190307 | 2,800,000.00 | 3,162,040.00 | |
| | 4.5 GILT 340907 | 2,400,000.00 | 2,774,040.00 | |
| | 4.5 GILT 421207 | 2,200,000.00 | 2,591,050.00 | |
| | 4.75 GILT 150907 | 3,100,000.00 | 3,313,900.00 | |
| | 4.75 GILT 200307 | 2,500,000.00 | 2,879,375.00 | |
| | 4.75 GILT 301207 | 2,300,000.00 | 2,721,130.00 | |

| | | | | |
|------|---------------------------|---------------|-----------------------------------|--|
| | 4.75 GILT 381207 | 2,200,000.00 | 2,660,460.00 | |
| | 5 GILT 180307 | 2,900,000.00 | 3,307,885.00 | |
| | 5 GILT 250307 | 2,200,000.00 | 2,628,450.00 | |
| | 6 GILT 281207 | 1,300,000.00 | 1,729,130.00 | |
| | 8 GILT 151207 | 600,000.00 | 684,450.00 | |
| | 8 GILT 210607 | 1,500,000.00 | 2,070,075.00 | |
| | 8.75 GILT 170825 | 800,000.00 | 1,009,800.00 | |
| | 国債証券 小計 | 82,300,000.00 | 90,134,215.00 (15,381,403,789) | |
| | イギリスポンド 小計 | 82,300,000.00 | 90,134,215.00 (15,381,403,789) | |
| | スイスフラン | | | |
| 国債証券 | 2.25 SWISS GOVT 200706 | 500,000.00 | 553,925.00 | |
| | 2.5 SWISS GOVT 160312 | 850,000.00 | 897,345.00 | |
| | 3 SWISS GOVT 180108 | 900,000.00 | 1,002,510.00 | |
| | 3 SWISS GOVT 190512 | 660,000.00 | 753,390.00 | |
| | 3.75 SWISS GOVT 150610 | 500,000.00 | 526,850.00 | |
| | 4 SWISS GOVT 230211 | 500,000.00 | 630,600.00 | |
| | 4 SWISS GOVT 280408 | 800,000.00 | 1,056,320.00 | |
| | 4.25 SWISS GOVT 170605 | 700,000.00 | 798,770.00 | |
| | 国債証券 小計 | 5,410,000.00 | 6,219,710.00 (717,567,942) | |
| | スイスフラン 小計 | 5,410,000.00 | 6,219,710.00 (717,567,942) | |
| | シンガポールドル | | | |
| 国債証券 | 0.25 SINGAPORGOVT 150201 | 300,000.00 | 299,736.00 | |
| | 0.5 SINGAPORGOVT 180401 | 300,000.00 | 292,557.00 | |
| | 1.125SINGAPORGOVT 160401 | 400,000.00 | 406,240.00 | |
| | 2.25 SINGAPORGOVT 210601 | 500,000.00 | 500,500.00 | |
| | 2.375 SINGAPORGOVT 170401 | 600,000.00 | 631,260.00 | |
| | 2.5 SINGAPORGOVT 190601 | 400,000.00 | 417,000.00 | |
| | 2.75 SINGAPORGOVT 420401 | 500,000.00 | 463,450.00 | |
| | 2.875SINGAPORGOVT 150701 | 900,000.00 | 933,210.00 | |
| | 2.875SINGAPORGOVT 300901 | 400,000.00 | 387,120.00 | |
| | 3 SINGAPORGOVT 240901 | 400,000.00 | 409,320.00 | |
| | 3.125SINGAPORGOVT 220901 | 700,000.00 | 736,890.00 | |
| | 3.25 SINGAPORGOVT 200901 | 600,000.00 | 643,920.00 | |
| | 3.375 SINGAPORGOVT 330901 | 100,000.00 | 103,139.00 | |
| | 3.5 SINGAPORGOVT 270301 | 600,000.00 | 632,700.00 | |
| | 3.75 SINGAPORGOVT 160901 | 700,000.00 | 759,640.00 | |
| | 4 SINGAPORGOVT 180901 | 600,000.00 | 672,180.00 | |
| | 国債証券 小計 | 8,000,000.00 | 8,288,862.00 (680,764,236) | |
| | シンガポールドル 小計 | 8,000,000.00 | 8,288,862.00 (680,764,236) | |
| | マレーシアリンギット | | | |
| 国債証券 | 3.172 MALAYSIA 160715 | 1,100,000.00 | 1,098,724.00 | |
| | 3.197 MALAYSIA GOV 151015 | 200,000.00 | 200,258.00 | |
| | 3.26 MALAYSIA GOV 180301 | 1,100,000.00 | 1,085,117.00 | |
| | 3.314 MALAYSIA 171031 | 1,100,000.00 | 1,088,681.00 | |
| | 3.418MALAYSIA GOV 220815 | 400,000.00 | 379,108.00 | |
| | 3.48 MALAYSIA GOV 230315 | 800,000.00 | 758,344.00 | |
| | 3.492 MALAYSIA GOV 200331 | 400,000.00 | 389,040.00 | |
| | 3.502MALAYSIA GOV 270531 | 1,900,000.00 | 1,704,813.00 | |
| | 3.58 MALAYSIA GOV 180928 | 1,600,000.00 | 1,588,512.00 | |
| | 3.741 MALAYSIA GOV 150227 | 2,200,000.00 | 2,216,368.00 | |
| | 3.814MALAYSIA GOV 170215 | 1,400,000.00 | 1,410,976.00 | |
| | 3.835MALAYSIA GOV 150812 | 2,500,000.00 | 2,528,425.00 | |
| | 3.889 MALAYSIA GOV 200731 | 1,900,000.00 | 1,892,628.00 | |
| | 3.892 MALAYSIA GOV 270315 | 1,200,000.00 | 1,122,936.00 | |
| | 4.012 MALAYSIA GOV 170915 | 2,500,000.00 | 2,535,075.00 | |
| | 4.127 MALAYSIA 320415 | 1,000,000.00 | 937,120.00 | |
| | 4.16 MALAYSIA GOV 210715 | 1,000,000.00 | 1,005,740.00 | |
| | 4.24 MALAYSIA GOV 180207 | 1,000,000.00 | 1,018,990.00 | |
| | 4.262MALAYSIA GOV 160915 | 3,300,000.00 | 3,383,259.00 | |
| | 4.378MALAYSIA GOV 191129 | 2,700,000.00 | 2,760,399.00 | |
| | 4.392 MALAYSIA GOV 260415 | 1,700,000.00 | 1,687,675.00 | |
| | 5.734MALAYSIA GOV 190730 | 700,000.00 | 761,684.00 | |

| | | | |
|------|--------------------------|----------------|-----------------------------------|
| | 国債証券 小計 | 31,700,000.00 | 31,553,872.00 (1,000,573,281) |
| | マレーシアリングギット 小計 | 31,700,000.00 | 31,553,872.00 (1,000,573,281) |
| | スウェーデンクローネ | | |
| 国債証券 | 1.5 SWD GOVT 231113 | 8,100,000.00 | 7,481,889.00 |
| | 3 SWD GOVT 160712 | 6,600,000.00 | 6,912,708.00 |
| | 3.5 SWD GOVT 220601 | 8,900,000.00 | 9,767,661.00 |
| | 3.5 SWD GOVT 390330 | 6,600,000.00 | 7,083,912.00 |
| | 3.75 SWD GOVT 170812 | 8,300,000.00 | 8,993,050.00 |
| | 4.25 SWD GOVT 190312 | 10,300,000.00 | 11,585,543.00 |
| | 4.5 SWD GOVT 150812 | 9,000,000.00 | 9,515,430.00 |
| | 5 SWD GOVT 201201 | 5,500,000.00 | 6,545,825.00 |
| | 国債証券 小計 | 63,300,000.00 | 67,886,018.00 (1,097,716,911) |
| | スウェーデンクローネ 小計 | 63,300,000.00 | 67,886,018.00 (1,097,716,911) |
| | ノルウェークローネ | | |
| 国債証券 | 2 NORWE GOVT 230524 | 4,800,000.00 | 4,446,240.00 |
| | 3.75 NORWE GOVT 210525 | 7,400,000.00 | 7,938,720.00 |
| | 4.25 NORWE GOVT 170519 | 7,600,000.00 | 8,201,160.00 |
| | 4.5 NORWE GOVT 190522 | 6,500,000.00 | 7,224,425.00 |
| | 5 NORWE GOVT 150515 | 9,500,000.00 | 9,944,125.00 |
| | 国債証券 小計 | 35,800,000.00 | 37,754,670.00 (638,053,923) |
| | ノルウェークローネ 小計 | 35,800,000.00 | 37,754,670.00 (638,053,923) |
| | デンマーククローネ | | |
| 国債証券 | 1.5 DMK GOVT 231115 | 6,400,000.00 | 6,196,800.00 |
| | 2.5 DMK GOVT 161115 | 2,300,000.00 | 2,442,140.00 |
| | 3 DMK GOVT 211115 | 12,600,000.00 | 13,991,040.00 |
| | 4 DMK GOVT 151115 | 12,500,000.00 | 13,385,625.00 |
| | 4 DMK GOVT 171115 | 6,100,000.00 | 6,907,335.00 |
| | 4 DMK GOVT 191115 | 10,500,000.00 | 12,241,950.00 |
| | 4.5 DMK GOVT 391115 | 15,200,000.00 | 20,453,120.00 |
| | 7 DMK GOVT 241110 | 3,000,000.00 | 4,509,300.00 |
| | 国債証券 小計 | 68,600,000.00 | 80,127,310.00 (1,526,425,255) |
| | デンマーククローネ 小計 | 68,600,000.00 | 80,127,310.00 (1,526,425,255) |
| | メキシコペソ | | |
| 国債証券 | 10 MEXICAN BONOS 241205 | 12,100,000.00 | 15,465,373.00 |
| | 10 MEXICAN BONOS 361120 | 8,200,000.00 | 10,431,958.00 |
| | 4.75 MEXICAN BONO 180614 | 5,800,000.00 | 5,680,520.00 |
| | 5 MEXICAN BONOS 170615 | 16,800,000.00 | 16,893,744.00 |
| | 6 MEXICAN BONOS 150618 | 10,000,000.00 | 10,310,300.00 |
| | 6.25 MEXICAN BONO 160616 | 18,200,000.00 | 19,093,256.00 |
| | 6.5 MEXICAN BONOS 210610 | 13,200,000.00 | 13,494,360.00 |
| | 6.5 MEXICAN BONOS 220609 | 13,300,000.00 | 13,473,033.00 |
| | 7.25 MEXICAN BONO 161215 | 15,500,000.00 | 16,668,855.00 |
| | 7.5 MEXICAN BONOS 270603 | 11,000,000.00 | 11,722,480.00 |
| | 7.75 MEXICAN BONO 171214 | 9,900,000.00 | 10,849,311.00 |
| | 7.75 MEXICAN BONO 310529 | 15,500,000.00 | 16,215,790.00 |
| | 7.75 MEXICAN BONO 421113 | 6,700,000.00 | 6,838,690.00 |
| | 8 MEXICAN BONOS 151217 | 12,900,000.00 | 13,872,789.00 |
| | 8 MEXICAN BONOS 200611 | 10,600,000.00 | 11,829,070.00 |
| | 8 MEXICAN BONOS 231207 | 9,400,000.00 | 10,478,368.00 |
| | 8.5 MEXICAN BONOS 181213 | 6,800,000.00 | 7,716,300.00 |
| | 8.5 MEXICAN BONOS 290531 | 11,200,000.00 | 12,723,984.00 |
| | 8.5 MEXICAN BONOS 381118 | 15,900,000.00 | 17,577,132.00 |
| | 国債証券 小計 | 223,000,000.00 | 241,335,313.00 (1,899,308,913) |
| | メキシコペソ 小計 | 223,000,000.00 | 241,335,313.00 (1,899,308,913) |
| | ポーランドズロチ | | |
| 国債証券 | 2.5 POLAND 180725 | 2,400,000.00 | 2,293,800.00 |
| | 3.75 POLAND 180425 | 4,300,000.00 | 4,346,655.00 |
| | 4 POLAND 231025 | 3,100,000.00 | 3,011,495.00 |
| | 4.75 POLAND 161025 | 3,100,000.00 | 3,235,470.00 |

| | | | | |
|------|--------------------------|---------------|----------------------------------|--|
| | 4.75 POLAND 170425 | 2,600,000.00 | 2,721,680.00 | |
| | 5 POLAND 160425 | 3,200,000.00 | 3,340,640.00 | |
| | 5.25 POLAND 171025 | 3,400,000.00 | 3,627,630.00 | |
| | 5.25 POLAND 201025 | 2,900,000.00 | 3,106,915.00 | |
| | 5.5 POLAND 150425 | 3,700,000.00 | 3,827,095.00 | |
| | 5.5 POLAND 191025 | 3,300,000.00 | 3,582,975.00 | |
| | 5.75 POLAND 211025 | 2,800,000.00 | 3,080,700.00 | |
| | 5.75 POLAND 220923 | 3,000,000.00 | 3,304,950.00 | |
| | 5.75 POLAND 290425 | 1,200,000.00 | 1,334,052.00 | |
| | 6.25 POLAND 151024 | 4,200,000.00 | 4,447,170.00 | |
| | POLAND 150725 | 900,000.00 | 863,550.00 | |
| | POLAND 160125 | 2,200,000.00 | 2,074,930.00 | |
| | 国債証券 小計 | 46,300,000.00 | 48,199,707.00 (1,642,164,017) | |
| | ポーランドズロチ 小計 | 46,300,000.00 | 48,199,707.00 (1,642,164,017) | |
| | 南アフリカランド | | | |
| 国債証券 | 10.5 SOUTH AFRICA 261221 | 17,100,000.00 | 19,975,023.00 | |
| | 6.25 SOUTH AFRICA 360331 | 9,600,000.00 | 6,999,840.00 | |
| | 6.5 SOUTH AFRICA 410228 | 8,600,000.00 | 6,299,070.00 | |
| | 6.75 SOUTH AFRICA 210331 | 11,400,000.00 | 10,757,838.00 | |
| | 7 SOUTH AFRICA 310228 | 9,500,000.00 | 7,913,215.00 | |
| | 7.25 SOUTH AFRICA 200115 | 11,000,000.00 | 10,812,670.00 | |
| | 7.75 SOUTH AFRICA 230228 | 5,200,000.00 | 5,104,164.00 | |
| | 8 SOUTH AFRICA 181221 | 10,600,000.00 | 10,885,458.00 | |
| | 8.25 SOUTH AFRICA 170915 | 10,200,000.00 | 10,588,314.00 | |
| | 8.5 SOUTH AFRICA 370131 | 1,100,000.00 | 1,026,234.00 | |
| | 8.75 SOUTH AFRICA 480228 | 5,300,000.00 | 5,015,496.00 | |
| | 国債証券 小計 | 99,600,000.00 | 95,377,322.00 (913,714,744) | |
| | 南アフリカランド 小計 | 99,600,000.00 | 95,377,322.00 (913,714,744) | |
| | ユーロ | | | |
| 国債証券 | 0 NETH GOVT 160415 | 1,100,000.00 | 1,092,355.00 | |
| | 0 SCHATS 150612 | 2,100,000.00 | 2,095,590.00 | |
| | 0.25 O.A.T 151125 | 2,400,000.00 | 2,398,320.00 | |
| | 0.25 OBL 180413 | 1,600,000.00 | 1,573,280.00 | |
| | 0.25 SCHATS 150313 | 2,100,000.00 | 2,102,625.00 | |
| | 0.25 SCHATS 150911 | 800,000.00 | 801,240.00 | |
| | 0.5 OBL 170407 | 2,300,000.00 | 2,309,315.00 | |
| | 0.5 OBL 171013 | 2,100,000.00 | 2,101,365.00 | |
| | 0.5 OBL 180223 | 2,100,000.00 | 2,091,180.00 | |
| | 0.75 NETH GOVT 150415 | 1,800,000.00 | 1,812,510.00 | |
| | 0.75 OBL 170224 | 2,100,000.00 | 2,126,040.00 | |
| | 1 BTAN 170725 | 2,200,000.00 | 2,221,780.00 | |
| | 1 O.A.T 180525 | 2,900,000.00 | 2,904,205.00 | |
| | 1 O.A.T 181125 | 2,400,000.00 | 2,385,360.00 | |
| | 1 OBL 181012 | 1,000,000.00 | 1,010,450.00 | |
| | 1.125 FINNISH GOV 180915 | 300,000.00 | 302,085.00 | |
| | 1.25 BEL GOVT 180622 | 1,000,000.00 | 1,007,400.00 | |
| | 1.25 NETH GOVT 180115 | 1,700,000.00 | 1,731,280.00 | |
| | 1.25 NETH GOVT 190115 | 300,000.00 | 302,580.00 | |
| | 1.25 OBL 161014 | 1,700,000.00 | 1,745,305.00 | |
| | 1.5 BUND 220904 | 2,100,000.00 | 2,081,310.00 | |
| | 1.5 BUND 230215 | 2,500,000.00 | 2,459,375.00 | |
| | 1.5 BUND 230515 | 2,000,000.00 | 1,958,500.00 | |
| | 1.5 FINNISH GOVT 230415 | 600,000.00 | 575,550.00 | |
| | 1.625 FINNISH GOV 220915 | 600,000.00 | 587,310.00 | |
| | 1.75 BTAN 170225 | 2,700,000.00 | 2,797,605.00 | |
| | 1.75 BUND 220704 | 3,100,000.00 | 3,145,725.00 | |
| | 1.75 FINNISH GOVT 160415 | 900,000.00 | 929,160.00 | |
| | 1.75 NETH GOVT 230715 | 1,800,000.00 | 1,745,910.00 | |
| | 1.75 O.A.T 230525 | 3,300,000.00 | 3,165,525.00 | |
| | 1.75 OBL 151009 | 2,400,000.00 | 2,465,760.00 | |
| | 1.875 FINNISH GOV 170415 | 700,000.00 | 729,750.00 | |
| | 1.95 AUSTRIA GOVT 190618 | 400,000.00 | 416,060.00 | |
| | 2 BTAN 150712 | 3,000,000.00 | 3,077,850.00 | |
| | 2 BUND 220104 | 2,700,000.00 | 2,809,080.00 | |

| | | | |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| 2 BUND 230815 | 1,800,000.00 | 1,834,560.00 | |
| 2 OBL 160226 | 1,600,000.00 | 1,661,200.00 | |
| 2.25 BEL GOVT 230622 | 1,300,000.00 | 1,284,205.00 | |
| 2.25 BTAN 160225 | 3,400,000.00 | 3,536,850.00 | |
| 2.25 BUND 200904 | 1,900,000.00 | 2,032,335.00 | |
| 2.25 BUND 210904 | 2,200,000.00 | 2,338,930.00 | |
| 2.25 ITALY GOVT 160515 | 900,000.00 | 919,395.00 | |
| 2.25 NETH GOVT 220715 | 2,100,000.00 | 2,157,750.00 | |
| 2.25 O.A.T 221025 | 2,800,000.00 | 2,832,620.00 | |
| 2.25 O.A.T 240525 | 200,000.00 | 196,420.00 | |
| 2.25 OBL 150410 | 2,700,000.00 | 2,769,390.00 | |
| 2.4 AUSTRIA GOVT 340523 | 200,000.00 | 187,410.00 | |
| 2.5 BTAN 150115 | 2,400,000.00 | 2,454,240.00 | |
| 2.5 BTAN 160725 | 3,300,000.00 | 3,472,590.00 | |
| 2.5 BUND 210104 | 2,400,000.00 | 2,601,000.00 | |
| 2.5 BUND 440704 | 2,000,000.00 | 1,926,500.00 | |
| 2.5 ITALY GOVT 150301 | 2,100,000.00 | 2,138,955.00 | |
| 2.5 NETH GOVT 170115 | 1,900,000.00 | 2,012,575.00 | |
| 2.5 NETH GOVT 330115 | 1,300,000.00 | 1,251,445.00 | |
| 2.5 O.A.T 201025 | 3,900,000.00 | 4,120,935.00 | |
| 2.5 OBL 150227 | 2,200,000.00 | 2,257,310.00 | |
| 2.625 FINNISH GOV 420704 | 400,000.00 | 386,080.00 | |
| 2.75 BEL GOVT 160328 | 1,200,000.00 | 1,262,040.00 | |
| 2.75 FINNISH GOVT 280704 | 500,000.00 | 511,550.00 | |
| 2.75 ITALY GOVT 161115 | 1,700,000.00 | 1,757,120.00 | |
| 2.75 NETH GOVT 150115 | 1,900,000.00 | 1,948,260.00 | |
| 2.75 O.A.T 271025 | 2,100,000.00 | 2,077,740.00 | |
| 2.75 OBL 160408 | 3,000,000.00 | 3,169,500.00 | |
| 2.75 SPAIN GOVT 150331 | 800,000.00 | 818,440.00 | |
| 3 BEL GOVT 190928 | 1,100,000.00 | 1,191,960.00 | |
| 3 BUND 200704 | 2,800,000.00 | 3,128,300.00 | |
| 3 ITALY GOVT 150415 | 2,400,000.00 | 2,463,360.00 | |
| 3 ITALY GOVT 150615 | 2,600,000.00 | 2,676,310.00 | |
| 3 ITALY GOVT 151101 | 3,200,000.00 | 3,312,480.00 | |
| 3 O.A.T 151025 | 4,600,000.00 | 4,822,180.00 | |
| 3 O.A.T 220425 | 4,000,000.00 | 4,311,600.00 | |
| 3 SPAIN GOVT 150430 | 3,200,000.00 | 3,288,320.00 | |
| 3.15 AUSTRIA GOVT 440620 | 600,000.00 | 627,210.00 | |
| 3.15 SPAIN GOVT 160131 | 2,600,000.00 | 2,706,990.00 | |
| 3.2 AUSTRIA GOVT 170220 | 1,400,000.00 | 1,516,130.00 | |
| 3.25 BEL GOVT 160928 | 1,700,000.00 | 1,825,375.00 | |
| 3.25 BUND 150704 | 3,200,000.00 | 3,344,000.00 | |
| 3.25 BUND 200104 | 2,800,000.00 | 3,161,060.00 | |
| 3.25 BUND 210704 | 2,300,000.00 | 2,612,455.00 | |
| 3.25 BUND 420704 | 1,900,000.00 | 2,118,690.00 | |
| 3.25 NETH GOVT 150715 | 2,100,000.00 | 2,194,395.00 | |
| 3.25 NETH GOVT 210715 | 2,400,000.00 | 2,664,000.00 | |
| 3.25 O.A.T 160425 | 4,000,000.00 | 4,260,600.00 | |
| 3.25 O.A.T 211025 | 4,500,000.00 | 4,952,925.00 | |
| 3.25 O.A.T 450525 | 900,000.00 | 876,015.00 | |
| 3.25 SPAIN GOVT 160430 | 3,100,000.00 | 3,239,035.00 | |
| 3.3 SPAIN GOVT 160730 | 2,100,000.00 | 2,199,540.00 | |
| 3.375 FINNISH GOV 200415 | 600,000.00 | 671,190.00 | |
| 3.4 AUSTRIA GOVT 221122 | 1,000,000.00 | 1,114,600.00 | |
| 3.5 AUSTRIA GOVT 150715 | 1,600,000.00 | 1,677,760.00 | |
| 3.5 AUSTRIA GOVT 210915 | 1,700,000.00 | 1,912,075.00 | |
| 3.5 BEL GOVT 150328 | 1,300,000.00 | 1,350,245.00 | |
| 3.5 BEL GOVT 170628 | 1,900,000.00 | 2,077,935.00 | |
| 3.5 BUND 160104 | 2,700,000.00 | 2,875,365.00 | |
| 3.5 BUND 190704 | 3,000,000.00 | 3,414,000.00 | |
| 3.5 FINNISH GOVT 210415 | 1,000,000.00 | 1,128,150.00 | |
| 3.5 ITALY GOVT 171101 | 2,500,000.00 | 2,634,750.00 | |
| 3.5 ITALY GOVT 180601 | 2,100,000.00 | 2,208,990.00 | |
| 3.5 ITALY GOVT 181201 | 700,000.00 | 735,245.00 | |
| 3.5 NETH GOVT 200715 | 2,200,000.00 | 2,480,720.00 | |
| 3.5 O.A.T 150425 | 3,600,000.00 | 3,747,780.00 | |
| 3.5 O.A.T 200425 | 4,700,000.00 | 5,264,000.00 | |

| | | | |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| 3.5 O.A.T 260425 | 4,100,000.00 | 4,446,245.00 | |
| 3.65 AUSTRIA GOVT 220420 | 1,400,000.00 | 1,590,120.00 | |
| 3.75 BEL GOVT 150928 | 1,200,000.00 | 1,270,200.00 | |
| 3.75 BEL GOVT 200928 | 2,200,000.00 | 2,485,560.00 | |
| 3.75 BEL GOVT 450622 | 500,000.00 | 526,325.00 | |
| 3.75 BUND 150104 | 3,100,000.00 | 3,207,260.00 | |
| 3.75 BUND 170104 | 2,500,000.00 | 2,752,875.00 | |
| 3.75 BUND 190104 | 2,900,000.00 | 3,317,310.00 | |
| 3.75 ITALY GOVT 150801 | 2,700,000.00 | 2,813,805.00 | |
| 3.75 ITALY GOVT 160415 | 3,000,000.00 | 3,165,150.00 | |
| 3.75 ITALY GOVT 160801 | 3,500,000.00 | 3,704,750.00 | |
| 3.75 ITALY GOVT 210301 | 3,000,000.00 | 3,124,350.00 | |
| 3.75 ITALY GOVT 210501 | 400,000.00 | 415,200.00 | |
| 3.75 ITALY GOVT 210801 | 3,600,000.00 | 3,739,140.00 | |
| 3.75 NETH GOVT 230115 | 1,800,000.00 | 2,063,070.00 | |
| 3.75 NETH GOVT 420115 | 1,800,000.00 | 2,124,900.00 | |
| 3.75 O.A.T 170425 | 4,300,000.00 | 4,733,870.00 | |
| 3.75 O.A.T 191025 | 3,800,000.00 | 4,303,880.00 | |
| 3.75 O.A.T 210425 | 4,400,000.00 | 5,003,240.00 | |
| 3.75 SPAIN GOVT 151031 | 2,000,000.00 | 2,097,200.00 | |
| 3.75 SPAIN GOVT 181031 | 2,100,000.00 | 2,241,120.00 | |
| 3.8 AUSTRIA GOVT 620126 | 400,000.00 | 486,720.00 | |
| 3.8 SPAIN GOVT 170131 | 3,000,000.00 | 3,203,550.00 | |
| 3.875 FINNISH GOVT170915 | 1,000,000.00 | 1,115,100.00 | |
| 3.9 AUSTRIA GOVT 200715 | 2,000,000.00 | 2,298,300.00 | |
| 3.9 IRISH GOVT 230320 | 600,000.00 | 632,340.00 | |
| 4 AUSTRIA GOVT 160915 | 1,700,000.00 | 1,862,265.00 | |
| 4 BEL GOVT 170328 | 1,400,000.00 | 1,547,490.00 | |
| 4 BEL GOVT 180328 | 1,600,000.00 | 1,798,560.00 | |
| 4 BEL GOVT 190328 | 1,500,000.00 | 1,705,200.00 | |
| 4 BEL GOVT 220328 | 1,800,000.00 | 2,057,400.00 | |
| 4 BEL GOVT 320328 | 1,100,000.00 | 1,225,730.00 | |
| 4 BUND 160704 | 3,200,000.00 | 3,494,880.00 | |
| 4 BUND 180104 | 3,200,000.00 | 3,634,400.00 | |
| 4 BUND 370104 | 2,800,000.00 | 3,441,900.00 | |
| 4 FINNISH GOVT 250704 | 800,000.00 | 936,480.00 | |
| 4 ITALY GOVT 170201 | 3,300,000.00 | 3,526,050.00 | |
| 4 ITALY GOVT 200901 | 3,200,000.00 | 3,410,240.00 | |
| 4 ITALY GOVT 370201 | 3,200,000.00 | 3,023,040.00 | |
| 4 NETH GOVT 160715 | 1,900,000.00 | 2,070,525.00 | |
| 4 NETH GOVT 180715 | 2,200,000.00 | 2,496,010.00 | |
| 4 NETH GOVT 190715 | 2,000,000.00 | 2,297,400.00 | |
| 4 NETH GOVT 370115 | 1,500,000.00 | 1,806,450.00 | |
| 4 O.A.T 180425 | 3,100,000.00 | 3,498,040.00 | |
| 4 O.A.T 381025 | 2,900,000.00 | 3,260,905.00 | |
| 4 O.A.T 550425 | 2,000,000.00 | 2,246,100.00 | |
| 4 O.A.T 600425 | 1,200,000.00 | 1,347,960.00 | |
| 4 SPAIN GOVT 150730 | 2,600,000.00 | 2,722,200.00 | |
| 4 SPAIN GOVT 200430 | 2,500,000.00 | 2,672,375.00 | |
| 4.1 SPAIN GOVT 180730 | 2,600,000.00 | 2,821,260.00 | |
| 4.15 AUSTRIA GOVT 370315 | 1,800,000.00 | 2,182,410.00 | |
| 4.2 SPAIN GOVT 370131 | 1,900,000.00 | 1,810,415.00 | |
| 4.25 BEL GOVT 210928 | 1,700,000.00 | 1,977,865.00 | |
| 4.25 BEL GOVT 220928 | 2,400,000.00 | 2,783,400.00 | |
| 4.25 BEL GOVT 410328 | 1,500,000.00 | 1,735,650.00 | |
| 4.25 BUND 170704 | 2,500,000.00 | 2,828,500.00 | |
| 4.25 BUND 180704 | 3,000,000.00 | 3,472,200.00 | |
| 4.25 BUND 390704 | 1,700,000.00 | 2,193,765.00 | |
| 4.25 FINNISH GOVT 150704 | 600,000.00 | 635,340.00 | |
| 4.25 ITALY GOVT 150201 | 2,600,000.00 | 2,692,560.00 | |
| 4.25 ITALY GOVT 190201 | 2,800,000.00 | 3,039,960.00 | |
| 4.25 ITALY GOVT 190901 | 3,400,000.00 | 3,687,640.00 | |
| 4.25 ITALY GOVT 200301 | 3,300,000.00 | 3,562,185.00 | |
| 4.25 O.A.T 171025 | 3,800,000.00 | 4,290,390.00 | |
| 4.25 O.A.T 181025 | 3,500,000.00 | 4,015,900.00 | |
| 4.25 O.A.T 190425 | 4,100,000.00 | 4,731,810.00 | |
| 4.25 O.A.T 231025 | 4,100,000.00 | 4,793,105.00 | |

| | | | |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| 4.25 SPAIN GOVT 161031 | 2,400,000.00 | 2,582,880.00 | |
| 4.3 AUSTRIA GOVT 170915 | 1,100,000.00 | 1,243,550.00 | |
| 4.3 SPAIN GOVT 191031 | 2,600,000.00 | 2,840,110.00 | |
| 4.35 AUSTRIA GOVT 190315 | 1,400,000.00 | 1,627,080.00 | |
| 4.375 FINNISH GOV 190704 | 700,000.00 | 818,125.00 | |
| 4.4 IRISH GOVT 190618 | 1,000,000.00 | 1,115,150.00 | |
| 4.4 SPAIN GOVT 150131 | 2,700,000.00 | 2,802,060.00 | |
| 4.4 SPAIN GOVT 231031 | 1,400,000.00 | 1,475,110.00 | |
| 4.5 BEL GOVT 260328 | 900,000.00 | 1,060,740.00 | |
| 4.5 IRISH GOVT 150218 | 500,000.00 | 522,475.00 | |
| 4.5 IRISH GOVT 181018 | 1,300,000.00 | 1,457,560.00 | |
| 4.5 IRISH GOVT 200418 | 1,500,000.00 | 1,671,975.00 | |
| 4.5 ITALY GOVT 150715 | 2,300,000.00 | 2,419,830.00 | |
| 4.5 ITALY GOVT 180201 | 3,100,000.00 | 3,383,030.00 | |
| 4.5 ITALY GOVT 180801 | 3,400,000.00 | 3,727,420.00 | |
| 4.5 ITALY GOVT 190301 | 2,800,000.00 | 3,074,820.00 | |
| 4.5 ITALY GOVT 200201 | 2,800,000.00 | 3,061,520.00 | |
| 4.5 ITALY GOVT 230501 | 2,400,000.00 | 2,553,600.00 | |
| 4.5 ITALY GOVT 240301 | 1,100,000.00 | 1,163,580.00 | |
| 4.5 ITALY GOVT 260301 | 2,800,000.00 | 2,949,660.00 | |
| 4.5 NETH GOVT 170715 | 1,900,000.00 | 2,152,320.00 | |
| 4.5 O.A.T 410425 | 3,100,000.00 | 3,765,725.00 | |
| 4.5 SPAIN GOVT 180131 | 2,800,000.00 | 3,070,620.00 | |
| 4.6 IRISH GOVT 160418 | 1,200,000.00 | 1,300,320.00 | |
| 4.6 SPAIN GOVT 190730 | 1,800,000.00 | 1,994,850.00 | |
| 4.65 AUSTRIA GOVT 180115 | 1,800,000.00 | 2,073,690.00 | |
| 4.65 SPAIN GOVT 250730 | 1,700,000.00 | 1,814,495.00 | |
| 4.7 SPAIN GOVT 410730 | 1,600,000.00 | 1,623,520.00 | |
| 4.75 BUND 280704 | 1,500,000.00 | 1,942,425.00 | |
| 4.75 BUND 340704 | 2,500,000.00 | 3,345,125.00 | |
| 4.75 BUND 400704 | 2,200,000.00 | 3,062,730.00 | |
| 4.75 ITALY GOVT 160915 | 2,200,000.00 | 2,387,440.00 | |
| 4.75 ITALY GOVT 170501 | 1,800,000.00 | 1,967,040.00 | |
| 4.75 ITALY GOVT 170601 | 2,000,000.00 | 2,185,700.00 | |
| 4.75 ITALY GOVT 210901 | 3,200,000.00 | 3,521,760.00 | |
| 4.75 ITALY GOVT 230801 | 3,100,000.00 | 3,369,080.00 | |
| 4.75 ITALY GOVT 280901 | 1,900,000.00 | 2,017,800.00 | |
| 4.75 ITALY GOVT 440901 | 700,000.00 | 714,805.00 | |
| 4.75 O.A.T 350425 | 2,500,000.00 | 3,107,500.00 | |
| 4.8 SPAIN GOVT 240131 | 1,900,000.00 | 2,061,215.00 | |
| 4.85 AUSTRIA GOVT 260315 | 900,000.00 | 1,130,040.00 | |
| 4.85 SPAIN GOVT 201031 | 2,400,000.00 | 2,674,800.00 | |
| 4.9 SPAIN GOVT 400730 | 1,700,000.00 | 1,779,305.00 | |
| 5 BEL GOVT 350328 | 2,300,000.00 | 2,912,260.00 | |
| 5 IRISH GOVT 201018 | 1,000,000.00 | 1,144,550.00 | |
| 5 ITALY GOVT 220301 | 2,300,000.00 | 2,554,150.00 | |
| 5 ITALY GOVT 250301 | 3,000,000.00 | 3,281,400.00 | |
| 5 ITALY GOVT 340801 | 2,600,000.00 | 2,781,090.00 | |
| 5 ITALY GOVT 390801 | 2,200,000.00 | 2,339,700.00 | |
| 5 ITALY GOVT 400901 | 2,700,000.00 | 2,861,730.00 | |
| 5 O.A.T 161025 | 3,900,000.00 | 4,385,940.00 | |
| 5.15 SPAIN GOVT 281031 | 600,000.00 | 661,830.00 | |
| 5.15 SPAIN GOVT 441031 | 500,000.00 | 537,425.00 | |
| 5.25 ITALY GOVT 170801 | 2,900,000.00 | 3,227,845.00 | |
| 5.25 ITALY GOVT 291101 | 3,600,000.00 | 3,987,000.00 | |
| 5.4 IRISH GOVT 250313 | 1,500,000.00 | 1,731,600.00 | |
| 5.4 SPAIN GOVT 230131 | 2,300,000.00 | 2,607,855.00 | |
| 5.5 BEL GOVT 170928 | 900,000.00 | 1,053,450.00 | |
| 5.5 BEL GOVT 280328 | 2,100,000.00 | 2,725,905.00 | |
| 5.5 BUND 310104 | 2,400,000.00 | 3,388,560.00 | |
| 5.5 IRISH GOVT 171018 | 700,000.00 | 800,100.00 | |
| 5.5 ITALY GOVT 220901 | 2,500,000.00 | 2,856,625.00 | |
| 5.5 ITALY GOVT 221101 | 2,800,000.00 | 3,202,780.00 | |
| 5.5 NETH GOVT 280115 | 1,700,000.00 | 2,295,595.00 | |
| 5.5 O.A.T 290425 | 3,400,000.00 | 4,475,590.00 | |
| 5.5 SPAIN GOVT 170730 | 2,100,000.00 | 2,369,535.00 | |
| 5.5 SPAIN GOVT 210430 | 3,200,000.00 | 3,683,680.00 | |

| | | | |
|--------------------------|----------------|--------------------------------------|--|
| 5.625 BUND 280104 | 1,800,000.00 | 2,515,320.00 | |
| 5.75 ITALY GOVT 330201 | 2,000,000.00 | 2,337,400.00 | |
| 5.75 O.A.T 321025 | 3,000,000.00 | 4,150,200.00 | |
| 5.75 SPAIN GOVT 320730 | 1,800,000.00 | 2,127,240.00 | |
| 5.85 SPAIN GOVT 220131 | 2,500,000.00 | 2,925,625.00 | |
| 5.9 IRISH GOVT 191018 | 800,000.00 | 954,720.00 | |
| 5.9 SPAIN GOVT 260730 | 1,300,000.00 | 1,541,020.00 | |
| 6 BUND 160620 | 300,000.00 | 341,595.00 | |
| 6 ITALY GOVT 310501 | 3,600,000.00 | 4,302,180.00 | |
| 6 O.A.T 251025 | 2,200,000.00 | 2,958,340.00 | |
| 6 SPAIN GOVT 290131 | 2,500,000.00 | 2,991,000.00 | |
| 6.25 AUSTRIA GOVT 270715 | 1,000,000.00 | 1,424,750.00 | |
| 6.25 BUND 240104 | 1,300,000.00 | 1,826,110.00 | |
| 6.25 BUND 300104 | 1,000,000.00 | 1,502,050.00 | |
| 6.5 BUND 270704 | 1,100,000.00 | 1,648,075.00 | |
| 6.5 ITALY GOVT 271101 | 3,800,000.00 | 4,712,570.00 | |
| 7.25 ITALY GOVT 261101 | 1,200,000.00 | 1,570,200.00 | |
| 8 BEL GOVT 150328 | 800,000.00 | 873,360.00 | |
| 8.5 O.A.T 191025 | 1,000,000.00 | 1,397,150.00 | |
| 8.5 O.A.T 230425 | 1,400,000.00 | 2,143,890.00 | |
| 9 ITALY GOVT 231101 | 1,500,000.00 | 2,143,650.00 | |
| 国債証券 小計 | 540,100,000.00 | 594,824,570.00 (84,572,157,362) | |
| ユーロ 小計 | 540,100,000.00 | 594,824,570.00 (84,572,157,362) | |
| 合 計 | | 193,999,769,664 (193,999,769,664) | |

(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 196銘柄 | 100.00% | 39.43% |
| カナダドル | 国債証券 30銘柄 | 100.00% | 2.34% |
| オーストラリアドル | 国債証券 16銘柄 | 100.00% | 1.49% |
| イギリスポンド | 国債証券 38銘柄 | 100.00% | 7.93% |
| スイスフラン | 国債証券 8銘柄 | 100.00% | 0.37% |
| シンガポールドル | 国債証券 16銘柄 | 100.00% | 0.35% |
| マレーシアリングギット | 国債証券 22銘柄 | 100.00% | 0.52% |
| スウェーデンクローネ | 国債証券 8銘柄 | 100.00% | 0.57% |
| ノルウェークローネ | 国債証券 5銘柄 | 100.00% | 0.33% |
| デンマーククローネ | 国債証券 8銘柄 | 100.00% | 0.79% |
| メキシコペソ | 国債証券 19銘柄 | 100.00% | 0.98% |
| ポーランドズロチ | 国債証券 16銘柄 | 100.00% | 0.85% |
| 南アフリカランド | 国債証券 11銘柄 | 100.00% | 0.47% |
| ユーロ | 国債証券 257銘柄 | 100.00% | 43.59% |

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成26年1月31日現在

(単位:円)

| | |
|-----------------|-----------------------------|
| 資産総額 | 2,889,641,116 |
| 負債総額 | 2,070,693 |
| 純資産総額(-) | 2,887,570,423 |
| 発行済口数 | 2,504,764,196 口 |
| 1口当たり純資産価額(/) | 1.1528 (1万口当たり 11,528) |

<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26年1月31日現在

(単位:円)

| | |
|-----------------|-----------------------------|
| 資産総額 | 192,211,226,195 |
| 負債総額 | 907,988,582 |
| 純資産総額(-) | 191,303,237,613 |
| 発行済口数 | 80,263,916,295 口 |
| 1口当たり純資産価額(/) | 2.3834 (1万口当たり 23,834) |

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

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

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

（2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

（4）受益権の譲渡

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

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

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

（5）受益権の譲渡の対抗要件

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

（6）受益権の再分割

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

（7）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額等

平成26年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運用戦略を決定します。

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

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

投資行動のモニタリング1

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

投資行動のモニタリング2

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

ファンドに関係する法人等の管理

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

運用・管理に関する監督

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

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

ファンドの運用体制等は平成26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26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 | 473 | 6,705,669 |
| 追加型公社債投資信託 | 18 | 759,921 |
| 単位型株式投資信託 | 17 | 400,148 |
| 単位型公社債投資信託 | 5 | 185,339 |
| 合計 | 513 | 8,051,078 |

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）財務諸表及び中間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。

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28期事業年度（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

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29期事業年度に係る中間会計期間（自平成25年4月1日至平成25年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

| | 第27期 (平成24年3月31日現在) | | 第28期 (平成25年3月31日現在) | |
|-----------------|------------------------|------------|------------------------|------------|
| (資産の部) | | | | |
| 流動資産 | | | | |
| 現金及び預金 | 2 | 14,298,590 | 2 | 22,261,065 |
| 有価証券 | 2 | 8,000,000 | 2 | 8,000,000 |
| 前払費用 | | 154,925 | | 159,117 |
| 未収入金 | | 13,813 | | 5,504 |
| 未収委託者報酬 | | 3,977,324 | | 4,489,181 |
| 未収収益 | 2 | 42,563 | 2 | 47,936 |
| 繰延税金資産 | | 339,052 | | 402,791 |
| 金銭の信託 | 2 | 30,000 | 2 | 30,000 |
| その他 | | 27,621 | | 39,167 |
| 流動資産合計 | | 26,883,891 | | 35,434,764 |
| 固定資産 | | | | |
| 有形固定資産 | | | | |
| 建物 | 1 | 281,399 | 1 | 270,058 |
| 器具備品 | 1 | 177,757 | 1 | 171,754 |
| 土地 | | 1,205,031 | | 1,205,031 |
| 有形固定資産合計 | | 1,664,188 | | 1,646,844 |
| 無形固定資産 | | | | |
| 電話加入権 | | 15,822 | | 15,822 |
| ソフトウェア | | 881,368 | | 857,424 |
| ソフトウェア仮勘定 | | 402,721 | | 430,432 |
| その他 | | 24 | | |
| 無形固定資産合計 | | 1,299,937 | | 1,303,679 |
| 投資その他の資産 | | | | |
| 投資有価証券 | | 14,456,313 | | 15,689,317 |
| 関係会社株式 | | 320,136 | | 320,136 |
| 長期性預金 | 2 | 8,500,000 | 2 | 3,500,000 |
| 長期差入保証金 | 2 | 837,456 | 2 | 825,804 |
| 繰延税金資産 | | 139,650 | | |
| その他 | | 15,035 | | 15,035 |
| 投資その他の資産合計 | | 24,268,591 | | 20,350,294 |
| 固定資産合計 | | 27,232,718 | | 23,300,818 |
| 資産合計 | | 54,116,609 | | 58,735,583 |

(単位：千円)

| | 第27期 (平成24年3月31日現在) | 第28期 (平成25年3月31日現在) |
|----------------|------------------------|------------------------|
| (負債の部) | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 79,079 | 75,221 |
| 未払金 | | |
| 未払収益分配金 | 185,817 | 33,936 |
| 未払償還金 | 1,159,445 | 1,004,879 |
| 未払手数料 | 2 1,557,726 | 2 1,761,746 |
| その他未払金 | 50,899 | 84,763 |
| 未払費用 | 2 1,174,572 | 2 1,333,574 |
| 未払消費税等 | 63,602 | 128,077 |
| 未払法人税等 | 1,532,874 | 1,686,070 |
| 賞与引当金 | 520,000 | 594,000 |
| その他 | 278,521 | 348,389 |
| 流動負債合計 | 6,602,539 | 7,050,661 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | 119,902 | 119,776 |
| 役員退職慰労引当金 | 49,735 | 65,103 |
| 時効後支払損引当金 | 195,228 | 201,877 |
| 繰延税金負債 | | 251,776 |
| 固定負債合計 | 364,866 | 638,533 |
| 負債合計 | 6,967,405 | 7,689,194 |
| (純資産の部) | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 2,000,131 | 2,000,131 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | 222,096 | 222,096 |
| 資本剰余金合計 | 222,096 | 222,096 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 342,589 | 342,589 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | 6,998,000 | 6,998,000 |
| 繰越利益剰余金 | 36,863,331 | 39,686,216 |
| 利益剰余金合計 | 44,203,921 | 47,026,806 |
| 株主資本合計 | 46,426,148 | 49,249,033 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券 | 723,054 | 1,797,355 |
| 評価差額金 | | |
| 評価・換算差額等合計 | 723,054 | 1,797,355 |
| 純資産合計 | 47,149,203 | 51,046,388 |
| 負債純資産合計 | 54,116,609 | 58,735,583 |

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

| | 第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日) | | 第28期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日) | |
|-------------|---------------------------------------|------------|---------------------------------------|------------|
| 営業収益 | | | | |
| 委託者報酬 | | 47,476,170 | | 48,411,166 |
| 投資顧問料 | | 15,335 | | 13,601 |
| その他営業収益 | | 153,305 | | 138,788 |
| 営業収益合計 | | 47,644,812 | | 48,563,556 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払手数料 | 2 | 19,292,904 | 2 | 19,724,426 |
| 広告宣伝費 | | 516,886 | | 543,508 |
| 公告費 | | 7,961 | | 1,748 |
| 調査費 | | | | |
| 調査費 | | 909,999 | | 942,478 |
| 委託調査費 | | 9,975,300 | | 10,699,987 |
| 事務委託費 | | 306,137 | | 242,537 |
| 営業雑経費 | | | | |
| 通信費 | | 90,066 | | 89,308 |
| 印刷費 | | 400,552 | | 443,177 |
| 協会費 | | 40,636 | | 39,963 |
| 諸会費 | | 7,593 | | 7,621 |
| 事務機器関連費 | | 958,507 | | 971,457 |
| その他営業雑経費 | | 16,396 | | 8,989 |
| 営業費用合計 | | 32,522,943 | | 33,715,204 |
| 一般管理費 | | | | |
| 給料 | | | | |
| 役員報酬 | | 202,812 | | 198,915 |
| 給料・手当 | | 3,623,556 | | 3,740,875 |
| 賞与引当金繰入 | | 520,000 | | 594,000 |
| 福利厚生費 | | 520,897 | | 593,073 |
| 交際費 | | 26,743 | | 23,259 |
| 旅費交通費 | | 153,892 | | 139,968 |
| 租税公課 | | 102,255 | | 115,450 |
| 不動産賃借料 | | 698,539 | | 699,860 |
| 退職給付費用 | | 142,883 | | 162,650 |
| 役員退職慰勞引当金繰入 | | 22,805 | | 19,007 |
| 固定資産減価償却費 | | 481,601 | | 442,844 |
| 諸経費 | | 247,162 | | 270,874 |
| 一般管理費合計 | | 6,743,148 | | 7,000,782 |
| 営業利益 | | 8,378,719 | | 7,847,569 |

(単位：千円)

| | 第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日) | | 第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日) | |
|--------------|-------------------------------------|-----------|-------------------------------------|-----------|
| 営業外収益 | | | | |
| 受取配当金 | | 153,215 | | 213,088 |
| 有価証券利息 | 2 | 8,160 | 2 | 6,698 |
| 受取利息 | 2 | 25,661 | 2 | 25,684 |
| 投資有価証券償還益 | | 1,876 | | 6,072 |
| 収益分配金等時効完成分 | | 318,285 | | 412,323 |
| その他 | | 7,856 | | 1,935 |
| 営業外収益合計 | | 515,056 | | 665,802 |
| 営業外費用 | | | | |
| 投資有価証券償還損 | | | | 8,689 |
| 時効後支払損引当金繰入 | | 15,288 | | 16,881 |
| 事務過誤費 | | 7,845 | | 186 |
| その他 | | 82 | | 45 |
| 営業外費用合計 | | 23,216 | | 25,802 |
| 経常利益 | | 8,870,559 | | 8,487,569 |
| 特別利益 | | | | |
| 投資有価証券売却益 | | 150,103 | | 334,775 |
| 特別利益合計 | | 150,103 | | 334,775 |
| 特別損失 | | | | |
| 投資有価証券売却損 | | 153,276 | | 32,155 |
| 関係会社株式売却損 | | 13,563 | | |
| 投資有価証券評価損 | | 1,925 | | |
| 固定資産除却損 | 1 | 17,034 | 1 | 253 |
| その他 | | 412 | | |
| 特別損失合計 | | 186,212 | | 32,409 |
| 税引前当期純利益 | | 8,834,449 | | 8,789,934 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 3,510,046 | | 3,441,310 |
| 法人税等調整額 | | 175,067 | | 55,499 |
| 法人税等合計 | | 3,685,113 | | 3,385,811 |
| 当期純利益 | | 5,149,336 | | 5,404,123 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

| | 第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日) | 第28期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日) |
|--------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 株主資本 | | |
| 資本金 | | |
| 当期首残高 | 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 | | |
| 当期首残高 | 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 | | |
| 当期首残高 | 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 | | |
| 当期首残高 | 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 | | |
| 当期首残高 | 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 | | |
| 当期首残高 | 34,903,313 | 36,863,331 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 3,189,318 | 2,581,238 |
| 当期純利益 | 5,149,336 | 5,404,123 |
| 当期変動額合計 | 1,960,017 | 2,822,884 |
| 当期末残高 | 36,863,331 | 39,686,216 |
| 利益剰余金合計 | | |
| 当期首残高 | 42,243,903 | 44,203,921 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 3,189,318 | 2,581,238 |
| 当期純利益 | 5,149,336 | 5,404,123 |
| 当期変動額合計 | 1,960,017 | 2,822,884 |
| 当期末残高 | 44,203,921 | 47,026,806 |
| 株主資本合計 | | |
| 当期首残高 | 44,466,131 | 46,426,148 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 3,189,318 | 2,581,238 |
| 当期純利益 | 5,149,336 | 5,404,123 |
| 当期変動額合計 | 1,960,017 | 2,822,884 |
| 当期末残高 | 46,426,148 | 49,249,032 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | | |
| 当期首残高 | 391,537 | 723,054 |

| | | |
|---------------------|------------|------------|
| 当期変動額 | | |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | 331,516 | 1,074,300 |
| 当期変動額合計 | 331,516 | 1,074,300 |
| 当期末残高 | 723,054 | 1,797,355 |
| 評価・換算差額等合計 | | |
| 当期首残高 | 391,537 | 723,054 |
| 当期変動額 | | |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | 331,516 | 1,074,300 |
| 当期変動額合計 | 331,516 | 1,074,300 |
| 当期末残高 | 723,054 | 1,797,355 |
| 純資産合計 | | |
| 当期首残高 | 44,857,668 | 47,149,203 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 3,189,318 | 2,581,238 |
| 当期純利益 | 5,149,336 | 5,404,123 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | 331,516 | 1,074,300 |
| 当期変動額合計 | 2,291,534 | 3,897,185 |
| 当期末残高 | 47,149,203 | 51,046,388 |

[注記事項]

（重要な会計方針）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は、建物38年であります。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

4. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(2) 退職給付引当金

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

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。

(3) 役員退職慰労引当金

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

(4) 時効後支払損引当金

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

5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

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

（会計方針の変更）

法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。

なお、この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微であります。

(未適用の会計基準等)

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

(1)概要

本会計基準等は、財務報告を改善する観点及び国際的な動向を踏まえ、退職給付債務の計算方法並びに開示の拡充を中心に改正されたものです。

(2)適用予定日

平成26年3月期の期末より適用予定です。ただし、退職給付債務の計算方法の改正については、平成27年3月期の期首より適用予定です。

(3)当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中です。

(貸借対照表関係)

1.有形固定資産の減価償却累計額

| | 第27期 (平成24年3月31日現在) | 第28期 (平成25年3月31日現在) |
|------|------------------------|------------------------|
| 建物 | 208,976千円 | 233,990千円 |
| 器具備品 | 294,294千円 | 351,481千円 |

2.関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

| | 第27期 (平成24年3月31日現在) | 第28期 (平成25年3月31日現在) |
|---------|------------------------|------------------------|
| 預金 | 11,773,728千円 | 19,410,015千円 |
| 有価証券 | 8,000,000千円 | 8,000,000千円 |
| 未収収益 | 42,563千円 | 40,120千円 |
| 金銭の信託 | 30,000千円 | 30,000千円 |
| 長期性預金 | 8,500,000千円 | 3,500,000千円 |
| 長期差入保証金 | 828,908千円 | 816,823千円 |
| 未払手数料 | 851,491千円 | 927,107千円 |
| 未払費用 | 135,926千円 | 148,712千円 |

(損益計算書関係)

1.固定資産除却損の内訳

| | 第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日) | 第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日) |
|--------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 器具備品 | 1,144千円 | 253千円 |
| ソフトウェア | 15,890千円 | - |
| 計 | 17,034千円 | 253千円 |

2.関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

| | 第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日) | 第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日) |
|--------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 支払手数料 | 10,760,427千円 | 10,230,968千円 |
| 有価証券利息 | 6,532千円 | 5,170千円 |
| 受取利息 | 25,661千円 | 25,684千円 |

（株主資本等変動計算書関係）

第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成23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 | 3,189,318千円 |
| 1株当たり配当額 | 25,700円 |
| 基準日 | 平成23年3月31日 |
| 効力発生日 | 平成23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24年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

| | |
|----------|-------------|
| 配当金の総額 | 2,581,238千円 |
| 配当の原資 | 利益剰余金 |
| 1株当たり配当額 | 20,800円 |
| 基準日 | 平成24年3月31日 |
| 効力発生日 | 平成24年6月27日 |

第28期（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成24年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

| | |
|----------|-------------|
| 配当金の総額 | 2,581,238千円 |
| 1株当たり配当額 | 20,800円 |
| 基準日 | 平成24年3月31日 |
| 効力発生日 | 平成24年6月27日 |

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

平成25年6月24日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

| | |
|----------|-------------|
| 配当金の総額 | 2,705,336千円 |
| 配当の原資 | 利益剰余金 |
| 1株当たり配当額 | 21,800円 |
| 基準日 | 平成25年3月31日 |
| 効力発生日 | 平成25年6月25日 |

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

第27期(平成24年3月31日現在)

| | 貸借対照表 計上額(千円) | 時価(千円) | 差額(千円) |
|-------------|------------------|------------|--------|
| (1) 現金及び預金 | 14,298,590 | 14,298,590 | - |
| (2) 有価証券 | 8,000,000 | 8,000,000 | - |
| (3) 未収委託者報酬 | 3,977,324 | 3,977,324 | - |
| (4) 長期性預金 | 8,500,000 | 8,509,886 | 9,886 |
| (5) 投資有価証券 | 14,417,413 | 14,417,413 | - |
| 資産計 | 49,193,328 | 49,203,214 | 9,886 |
| (1) 未払手数料 | 1,557,726 | 1,557,726 | - |
| (2) 未払法人税等 | 1,532,874 | 1,532,874 | - |
| 負債計 | 3,090,600 | 3,090,600 | - |

第28期(平成25年3月31日現在)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資産

(1) 現金及び預金、(2) 有価証券、(3) 未収委託者報酬

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

負債

(1) 未払手数料、(2) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

| 区分 | 第27期 (平成24年3月31日現在) | 第28期 (平成25年3月31日現在) |
|--------|------------------------|------------------------|
| 非上場株式 | 38,900 | 38,900 |
| 子会社株式 | 160,600 | 160,600 |
| 関連会社株式 | 159,536 | 159,536 |

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第27期(平成24年3月31日現在)

(単位:千円)

| | 1年以内 | 1年超 5年以内 | 5年超 10年以内 | 10年超 |
|-------------------|------------|-------------|--------------|-----------|
| 現金及び預金 | 14,298,590 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 3,977,324 | - | - | - |
| 有価証券及び投資有価証券 | | | | |
| その他有価証券のうち満期があるもの | | | | |
| 譲渡性預金 | 8,000,000 | - | - | - |
| 投資信託 | - | 3,168,056 | 4,412,092 | 2,183,060 |
| 長期性預金 | - | 8,500,000 | - | - |
| 合計 | 26,275,914 | 11,668,056 | 4,412,092 | 2,183,060 |

第28期(平成25年3月31日現在)

(単位:千円)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第27期(平成24年3月31日現在)

| | 種類 | 貸借対照表計上額 (千円) | 取得原価 (千円) | 差額(千円) |
|--------------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの | 株式 | - | - | - |
| | 債券 | - | - | - |
| | その他 | 11,092,127 | 9,993,766 | 1,098,361 |
| | 小計 | 11,092,127 | 9,993,766 | 1,098,361 |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの | 株式 | - | - | - |
| | 債券 | - | - | - |
| | その他 | 3,325,285 | 3,446,474 | 121,188 |
| | 小計 | 3,325,285 | 3,446,474 | 121,188 |
| 合計 | | 14,417,413 | 13,440,240 | 977,173 |

第28期(平成25年3月31日現在)

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

3. 売却したその他有価証券

第27期(自平成23年4月1日至平成24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 | 158,639 | - | 64,792 |
| 債券 | - | - | - |
| その他 | 3,036,630 | 150,103 | 88,484 |
| 合計 | 3,195,269 | 150,103 | 153,276 |

第28期(自平成24年4月1日至平成25年3月31日)

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

（デリバティブ取引関係）
重要な取引はありません。

（退職給付関係）

1.採用している退職給付制度の概要

当社は、従業員に対して確定拠出年金制度、退職一時金制度及び確定給付年金制度を設けております。
なお、平成23年10月に適格退職年金制度を廃止し、確定給付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27期 (平成24年3月31日現在) | 第28期 (平成25年3月31日現在) |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| (1)退職給付債務 | 475,564 | 382,988 |
| (2)年金資産 | 198,994 | 143,462 |
| (3)未積立退職給付債務 (1)+(2) | 276,569 | 239,525 |
| (4)未認識数理計算上の差異 | 156,666 | 119,749 |
| (5)貸借対照表計上額純額 (3)+(4) | 119,902 | 119,776 |
| (6)退職給付引当金 | 119,902 | 119,776 |

3.退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

| | 第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日) | 第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日) |
|-------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| (1)勤務費用 | 27,806 | 26,748 |
| (2)利息費用 | 8,420 | 7,087 |
| (3)期待運用収益 | 4,635 | 2,984 |
| (4)数理計算上の差異の費用処理額 | 13,599 | 27,653 |
| (5)退職給付費用 | 45,191 | 58,504 |
| (6)その他 | 97,692 | 104,146 |
| (7)合計 | 142,883 | 162,650 |

（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.退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

（1）退職給付見込額の期間配分方法
期間定額基準

（2）割引率

| 第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日) | 第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日) |
|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 1.5% | 1.5% |

（3）期待運用収益率

| 第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日) | 第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日) |
|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 1.5% | 1.5% |

（4）数理計算上の差異の処理年数

8年（各事業年度の発生時における従業員の平均支払期間以内の一定の年数による定額法により、翌事業年度より費用処理しております。）

（税効果会計関係）

1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

| | 第27期 (平成24年3月31日現在) | 第28期 (平成25年3月31日現在) |
|--------|------------------------|------------------------|
| 繰延税金資産 | | |

| | | |
|--------------|------------|------------|
| 減損損失 | 557,868 千円 | 542,460 千円 |
| 投資有価証券評価損 | 362,665 | 226,404 |
| ゴルフ会員権評価損 | 8,505 | 8,505 |
| 未払事業税 | 109,608 | 140,336 |
| 賞与引当金 | 197,652 | 225,779 |
| 役員退職慰労引当金 | 17,725 | 23,202 |
| 退職給付引当金 | 42,783 | 45,495 |
| 減価償却超過額 | 19,890 | 10,083 |
| 委託者報酬 | 99,265 | 124,166 |
| 長期差入保証金 | 21,895 | 26,203 |
| 時効後支払損引当金 | 69,579 | 71,948 |
| その他 | 39,304 | 48,666 |
| 繰延税金資産 小計 | 1,546,744 | 1,493,253 |
| 評価性引当額 | 813,923 | 704,932 |
| 繰延税金資産 合計 | 732,821 | 788,320 |
| 繰延税金負債 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 254,118 | 637,305 |
| 繰延税金負債 合計 | 254,118 | 637,305 |
| 繰延税金資産の純額 | 478,702 | 151,015 |

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第27期(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)及び第28期(自平成24年4月1日至平成25年3月31日)
当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第27期(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)及び第28期(自平成24年4月1日至平成25年3月31日)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 | |
|------|--------------|---------|------------------|-------------|--------------------|-------------------------------|-------------------|-------------------|------------------|---------------|-----------------|
| 親会社 | 三菱UFJ信託銀行(株) | 東京都千代田区 | 324,279 百万円 | 信託業、 銀行業 | 被所有 直接 50.0% | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払 | 4,404,897 千円 | 未払手数料 | 285,119 千円 | |
| | | | | | | | 事務所の賃借 | 667,780 千円 | 長期差入保証金 | 812,027 千円 | |
| | | | | | | | 投資の助言 | 168,292 千円 | 未払費用 | 81,330 千円 | |
| | | | | | | | 株式の売却 | 98,112 千円 | | | |
| 主要株主 | (株)三菱東京UFJ銀行 | 東京都千代田区 | 1,711,958 百万円 | 銀行業 | 被所有 直接 25.0% | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払 | 6,371,303 千円 | 未払手数料 | 566,371 千円 | |
| | | | | | | | 取引銀行 | 譲渡性預金の預入 | 36,000,000 千円 | 有価証券 | 8,000,000 千円 |
| | | | | | | | | 譲渡性預金に係る受取利息 | 6,532 千円 | 未収収益 | 544 千円 |
| | | | | | | | | マルチコーラブル預金の預入 | 7,000,000 千円 | 現金及び預金 | 5,500,000 千円 |
| | | | | | | | | マルチコーラブル預金に係る受取利息 | 24,415 千円 | 未収収益 | 2,886 千円 |
| | | | | | | | 長期性預金 | 8,500,000 千円 | | | |

第28期（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 | |
|------|--------------|---------|------------------|-------------|--------------------|-------------------------------|-------------------|-------------------|------------------|---------------|------------------|
| 親会社 | 三菱UFJ信託銀行(株) | 東京都千代田区 | 324,279 百万円 | 信託業、 銀行業 | 被所有 直接 50.0% | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払 | 4,556,241 千円 | 未払手数料 | 324,725 千円 | |
| | | | | | | | 事務所の賃借 | 事務所賃借料 | 671,086 千円 | 長期差入保証金 | 812,027 千円 |
| | | | | | | | 投資の助言 | 投資助言料 | 167,142 千円 | 未払費用 | 85,301 千円 |
| 主要株主 | (株)三菱東京UFJ銀行 | 東京都千代田区 | 1,711,958 百万円 | 銀行業 | 被所有 直接 25.0% | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払 | 5,674,726 千円 | 未払手数料 | 602,382 千円 | |
| | | | | | | | 取引銀行 | 譲渡性預金の預入 | 30,000,000 千円 | 有価証券 | 8,000,000 千円 |
| | | | | | | | | 譲渡性預金に係る受取利息 | 5,170 千円 | 未収収益 | 717 千円 |
| | | | | | | | | マルチコーラブル預金の預入 | 5,500,000 千円 | 現金及び預金 | 10,500,000 千円 |
| | | | | | | | | マルチコーラブル預金に係る受取利息 | 24,246 千円 | 未収収益 | 2,301 千円 |
| | | | | | | | | 長期性預金 | 3,500,000 千円 | | |

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

事務所敷金及び賃借料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。

売却価額については、第三者機関による企業価値評価をもとに決定しております。

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

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

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等
第27期(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 |
|-------------|------------------------|---------|---------------|-------|----------------|-------------------------------|-------------------|-----------------|-------|---------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱ | 東京都千代田区 | 40,500 百万円 | 証券業 | なし | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払 | 3,914,481 千円 | 未払手数料 | 285,874 千円 |

第28期(自平成24年4月1日至平成25年3月31日)

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

(注)取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2.親会社に関する注記

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

三菱UFJ信託銀行株式会社(非上場)

(1株当たり情報)

| | 第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日) | 第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日) |
|--------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 1株当たり純資産額 | 379,935.23円 | 411,339.33円 |
| 1株当たり当期純利益金額 | 41,494.11円 | 43,547.22円 |

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日) | 第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日) |
|------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 当期純利益金額 (千円) | 5,149,336 | 5,404,123 |
| 普通株主に帰属しない金額 (千円) | - | - |
| 普通株式に係る当期純利益金額 (千円) | 5,149,336 | 5,404,123 |
| 期中平均株式数 (株) | 124,098 | 124,098 |

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

| 第29期中間会計期間 (平成25年9月30日現在) | |
|------------------------------|-------------------|
| (資産の部) | |
| 流動資産 | |
| 現金及び預金 | 23,548,500 |
| 有価証券 | 6,562,983 |
| 前払費用 | 236,694 |
| 未収入金 | 335,237 |
| 未収委託者報酬 | 4,948,498 |
| 未収収益 | 56,552 |
| 繰延税金資産 | 385,903 |
| 金銭の信託 | 30,000 |
| その他 | 57,563 |
| 流動資産合計 | 36,161,935 |
| 固定資産 | |
| 有形固定資産 | |
| 建物 | 1 259,238 |
| 器具備品 | 1 174,123 |
| 土地 | 1,205,031 |
| 有形固定資産合計 | 1,638,393 |
| 無形固定資産 | |
| 電話加入権 | 15,822 |
| ソフトウェア | 1,060,576 |
| ソフトウェア仮勘定 | 242,958 |
| 無形固定資産合計 | 1,319,357 |
| 投資その他の資産 | |
| 投資有価証券 | 16,782,208 |
| 関係会社株式 | 320,136 |
| 長期性預金 | 2,000,000 |
| 長期差入保証金 | 819,880 |
| 繰延税金資産 | 49,612 |
| その他 | 15,035 |
| 投資その他の資産合計 | 19,986,873 |
| 固定資産合計 | 22,944,625 |
| 資産合計 | 59,106,560 |

(単位：千円)

第29期中間会計期間

(平成25年9月30日現在)

(負債の部)

流動負債

| | | |
|---------|---|------------------|
| 預り金 | | 61,657 |
| 未払金 | | |
| 未払収益分配金 | | 63,875 |
| 未払償還金 | | 946,113 |
| 未払手数料 | | 1,982,655 |
| その他未払金 | | 72,079 |
| 未払費用 | | 1,409,174 |
| 未払消費税等 | 2 | 176,997 |
| 未払法人税等 | | 1,913,828 |
| 賞与引当金 | | 534,891 |
| その他 | | 400,856 |
| 流動負債合計 | | <u>7,562,129</u> |

固定負債

| | | |
|-----------|--|----------------|
| 退職給付引当金 | | 246,154 |
| 役員退職慰労引当金 | | 53,775 |
| 時効後支払損引当金 | | 198,603 |
| 固定負債合計 | | <u>498,533</u> |

負債合計

8,060,662

(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 | | <u>222,096</u> |
| 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 | | 39,994,517 |
| 利益剰余金合計 | | <u>47,335,107</u> |
| 株主資本合計 | | <u>49,557,335</u> |

評価・換算差額等

| | | |
|------------|--|------------------|
| その他有価証券 | | 1,488,562 |
| 評価差額金 | | |
| 評価・換算差額等合計 | | <u>1,488,562</u> |

純資産合計

51,045,897

負債純資産合計

59,106,560

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

| | | 第29期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日) |
|--------------|---|---|
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | | 26,575,676 |
| 投資顧問料 | | 53,790 |
| その他営業収益 | | 55,619 |
| 営業収益合計 | | 26,685,086 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | | 10,846,750 |
| 広告宣伝費 | | 330,957 |
| 公告費 | | 1,062 |
| 調査費 | | |
| 調査費 | | 486,652 |
| 委託調査費 | | 5,888,736 |
| 事務委託費 | | 116,669 |
| 営業雑経費 | | |
| 通信費 | | 46,024 |
| 印刷費 | | 243,552 |
| 協会費 | | 20,030 |
| 諸会費 | | 4,256 |
| 事務機器関連費 | | 509,881 |
| その他営業雑経費 | | 4,944 |
| 営業費用合計 | | 18,499,516 |
| 一般管理費 | | |
| 給料 | | |
| 役員報酬 | | 103,937 |
| 給料・手当 | | 1,649,702 |
| 賞与引当金繰入 | | 534,891 |
| 福利厚生費 | | 294,158 |
| 交際費 | | 10,544 |
| 旅費交通費 | | 75,335 |
| 租税公課 | | 62,774 |
| 不動産賃借料 | | 349,810 |
| 退職給付費用 | | 192,772 |
| 役員退職慰労引当金繰入 | | 11,027 |
| 固定資産減価償却費 | 1 | 214,015 |
| 諸経費 | | 136,511 |
| 一般管理費合計 | | 3,635,481 |
| 営業利益 | | 4,550,087 |

(単位：千円)

| 第29期中間会計期間 | |
|---------------|-----------|
| (自 平成25年4月1日 | |
| 至 平成25年9月30日) | |
| 営業外収益 | |
| 受取配当金 | 150,506 |
| 有価証券利息 | 2,185 |
| 受取利息 | 10,693 |
| 投資有価証券償還益 | 1,862 |
| 収益分配金等時効完成分 | 54,825 |
| その他 | 1,293 |
| 営業外収益合計 | 221,366 |
| 営業外費用 | |
| その他 | 4,535 |
| 営業外費用合計 | 4,535 |
| 経常利益 | 4,766,918 |
| 特別利益 | |
| 投資有価証券売却益 | 177,223 |
| 特別利益合計 | 177,223 |
| 特別損失 | |
| 投資有価証券売却損 | 34,236 |
| 固定資産除却損 | 462 |
| 特別損失合計 | 34,698 |
| 税引前中間純利益 | 4,909,443 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 1,913,166 |
| 法人税等調整額 | 17,360 |
| 法人税等合計 | 1,895,805 |
| 中間純利益 | 3,013,637 |

(3)中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

| | 第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30日) |
|--------------|---|
| 株主資本 | |
| 資本金 | |
| 当期首残高 | 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 | |
| 当期首残高 | 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 | |
| 当期首残高 | 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 | |
| 当期首残高 | 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 | |
| 当期首残高 | 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 | |
| 当期首残高 | 39,686,216 |
| 当中間期変動額 | |
| 剰余金の配当 | 2,705,336 |
| 中間純利益 | 3,013,637 |
| 当中間期変動額合計 | 308,301 |
| 当中間期末残高 | 39,994,517 |
| 利益剰余金合計 | |
| 当期首残高 | 47,026,806 |
| 当中間期変動額 | |
| 剰余金の配当 | 2,705,336 |
| 中間純利益 | 3,013,637 |
| 当中間期変動額合計 | 308,301 |
| 当中間期末残高 | 47,335,107 |
| 株主資本合計 | |
| 当期首残高 | 49,249,033 |
| 当中間期変動額 | |
| 剰余金の配当 | 2,705,336 |
| 中間純利益 | 3,013,637 |
| 当中間期変動額合計 | 308,301 |
| 当中間期末残高 | 49,557,335 |
| 評価・換算差額等 | |
| その他有価証券評価差額金 | |
| 当期首残高 | 1,797,355 |

| | |
|-----------------------|------------|
| 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) | 308,792 |
| 当中間期変動額合計 | 308,792 |
| 当中間期末残高 | 1,488,562 |
| 評価・換算差額等合計 | |
| 当期首残高 | 1,797,355 |
| 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) | 308,792 |
| 当中間期変動額合計 | 308,792 |
| 当中間期末残高 | 1,488,562 |
| 純資産合計 | |
| 当期首残高 | 51,046,388 |
| 当中間期変動額 | |
| 剰余金の配当 | 2,705,336 |
| 中間純利益 | 3,013,637 |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額) | 308,792 |
| 当中間期変動額合計 | 490 |
| 当中間期末残高 | 51,045,897 |

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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)を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は、建物38年であります。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、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、その発生年度の翌事業年度より一括費用処理することとしております。

(会計上の見積もりの変更)

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

これにより、従来の方法と比べて、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税金等調整前中間純利益はそれぞれ108百万円減少しております。

(3) 役員退職慰労引当金

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

(4) 時効後支払損引当金

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

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

(1) 消費税等の会計処理

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

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

| 第29期中間会計期間 (平成25年9月30日現在) | |
|------------------------------|-----------|
| 建物 | 245,895千円 |
| 器具備品 | 349,802千円 |

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)

1 減価償却実施額

| 第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30日) | |
|---|-----------|
| 有形固定資産 | 39,230千円 |
| 無形固定資産 | 174,785千円 |

(中間株主資本等変動計算書関係)

第29期中間会計期間(自平成25年4月1日至平成25年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

| | 当事業年度期首 株式数 (株) | 当中間会計期間 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25年6月24日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

| | |
|----------|-------------|
| 配当金の総額 | 2,705,336千円 |
| 配当の原資 | 利益剰余金 |
| 1株当たり配当額 | 21,800円 |
| 基準日 | 平成25年3月31日 |
| 効力発生日 | 平成25年6月25日 |

(金融商品関係)

第29期中間会計期間(平成25年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

平成25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)。

| | 中間貸借対照表 計上額(千円) | 時価(千円) | 差額(千円) |
|-------------|--------------------|------------|--------|
| (1) 現金及び預金 | 23,548,500 | 23,548,500 | - |
| (2) 有価証券 | 6,562,983 | 6,562,983 | - |
| (3) 未収委託者報酬 | 4,948,498 | 4,948,498 | - |
| (4) 長期性預金 | 2,000,000 | 2,000,898 | 898 |
| (5) 投資有価証券 | 16,743,308 | 16,743,308 | - |
| 資産計 | 53,803,291 | 53,804,190 | 898 |
| (1) 未払手数料 | 1,982,655 | 1,982,655 | - |
| (2) 未払法人税等 | 1,913,828 | 1,913,828 | - |
| 負債計 | 3,896,483 | 3,896,483 | - |

(注1)金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資 産

(1)現金及び預金、(3)未収委託者報酬

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

(2)有価証券

譲渡性預金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、投資信託は基準価額によっております。

(4)長期性預金

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

(5)投資有価証券

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

負 債

(1)未払手数料、(2)未払法人税等

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

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式(中間貸借対照表計上額38,900千円)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、子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円)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29期中間会計期間（平成25年9月30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（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）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 | 11,667,373 | 9,779,767 | 1,887,605 |
| | 小計 | 11,667,373 | 9,779,767 | 1,887,605 |
| 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 | 5,638,918 | 5,667,796 | 28,877 |
| | 小計 | 5,638,918 | 5,667,796 | 28,877 |
| 合計 | | 17,306,292 | 15,447,564 | 1,858,727 |

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額38,900千円）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）

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29期中間会計期間（自平成25年4月1日至平成25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29期中間会計期間（自平成25年4月1日至平成25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

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 第29期中間会計期間 (平成25年9月30日現在) |
|--------------------------------------|------------------------------|
| 1株当たり純資産額 | 411,335.37円 |
| (算定上の基礎) | |
| 純資産の部の合計額(千円) | 51,045,897 |
| 普通株式に係る中間期末の純資産額(千円) | 51,045,897 |
| 1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株) | 124,098 |

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30日) |
|--------------------|---|
| 1株当たり中間純利益金額 | 24,284.33円 |
| (算定上の基礎) | |
| 中間純利益金額(千円) | 3,013,637 |
| 普通株主に帰属しない金額(千円) | - |
| 普通株式に係る中間純利益金額(千円) | 3,013,637 |
| 普通株式の期中平均株式数(株) | 124,098 |

(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、記載しておりません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（平成25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25年9月末現在) | 事業の内容 |
|---------------|-----------------------|-------------------------------|
| 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。 |
| SMB C日興証券株式会社 | 10,000 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 | 5,957 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |

2【関係業務の概要】

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

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

3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（平成26年1月末現在）

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の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25年10月16日 | 半期報告書、有価証券届出書の訂正届出書 |
| 平成25年4月16日 | 有価証券報告書、有価証券届出書 |

独立監査人の監査報告書

平成25年6月24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 | 長島 拓也 | 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24年4月1日から平成25年3月31日までの第28期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ投信株式会社の平成25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成26年2月26日

三菱UFJ投信株式会社
取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 和田 渉 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ世界国債インデックスファンド（年1回決算型）の平成25年1月18日から平成26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。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ世界国債インデックスファンド（年1回決算型）の平成26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。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月6日

三菱UFJ投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

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

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

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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、我が国において一般に公正妥当と認められ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表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

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25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25年4月1日から平成25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。

利害関係

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

以 上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の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。なお、XBRLデータは中間監査の対象に含まれていません。