

投資信託説明書 (請求目論見書)

使用開始日 2024.5.3

海外債券セレクション(ラップ向け)

追加型投信／海外／債券

この目論見書により行う「海外債券セレクション(ラップ向け)」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2024年5月2日に関東財務局長に提出しており、2024年5月3日に効力が生じております。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づき作成され、投資者の請求により交付される目論見書(請求目論見書)です。

発行者名	: 三菱UFJアセットマネジメント株式会社
代表者の役職氏名	: 取締役社長 横川 直
本店の所在の場所	: 東京都港区東新橋一丁目9番1号
縦覧に供する場所	: 該当事項はありません。

目次

第一部【証券情報】	1
（1）【ファンドの名称】	1
（2）【内国投資信託受益証券の形態等】	1
（3）【発行（売出）価額の総額】	1
（4）【発行（売出）価格】	1
（5）【申込手数料】	1
（6）【申込単位】	1
（7）【申込期間】	1
（8）【申込取扱場所】	1
（9）【払込期日】	2
（10）【払込取扱場所】	2
（11）【振替機関に関する事項】	2
（12）【その他】	2
第二部【ファンド情報】	3
第1【ファンドの状況】	3
第2【管理及び運営】	37
第3【ファンドの経理状況】	43
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	108
第三部【委託会社等の情報】	108
第1【委託会社等の概況】	108
約款	153

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

海外債券セクション（ラップ向け）（「ファンド」といいます。）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

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

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

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

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

(5)【申込手数料】

ありません。

(6)【申込単位】

販売会社が定める単位

申込単位は販売会社にご確認ください。

(7)【申込期間】

2024年5月3日から2025年5月2日まで

※申込期間は、前記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新される予定です。

(8)【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

（ 9 ） 【 払込期日 】

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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

（ 1 0 ） 【 払込取扱場所 】

申込みを受け付けた販売会社です。

（ 1 1 ） 【 振替機関に関する事項 】

株式会社証券保管振替機構

（ 1 2 ） 【 その他 】

当ファンドは、ラップ口座に係る契約※に基づいてラップ口座の資金を運用するためのファンドであり、当ファンドの取得申込者は、販売会社にラップ口座を開設のうえ申込みを行うものとします。

※同様の権利義務関係を規定する契約の名称は販売会社によって異なります。

第二部【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、主として利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、5,000億円です。

*委託会社は、受託会社と合意のうえ、信託金の限度額を変更することができます。

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		
	海外	不動産投信	MR F	
追加型	内外	その他資産 ()	E T F	特殊型 ()
		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	年2回					
大型株	年4回	日本			TOPIX	条件付運用型
中小型株	年6回	北米	ファンド・	なし		
債券	(隔月)	欧州	オブ・		その他 ()	ロング・
一般	年12回	アジア	ファンズ			ショート型／
公債	(毎月)	オセアニア				絶対収益
社債	日々	中南米				追求型
その他債券	その他	アフリカ				その他 ()
クレジット	()	中近東 (中東)				
属性 ()		エマージング				
不動産投信						
その他資産 (投資信託証券 (債券 一般))						
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。商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）でご覧いただけます。

※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す。

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われない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「MR F 及びMMF の運営に関する規則」に規定するMMF をいいます。
	MR F（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「MR F 及びMMF の運営に関する規則」に規定するMR F 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（B B B 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（B B 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

海外債券を実質的な主要投資対象とし、主として利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。

ファンドの特色



投資信託証券への投資を通じて、主として海外債券に実質的な投資を行います。

- 投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。なお、2024年5月3日現在、投資対象となっている投資信託証券は以下の通りです。

<外国債券インデックスマザーファンド>

日本を除く世界主要国の公社債への投資を行います。

- ・FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)をベンチマークとします。
- ・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。
- ・FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)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、したがって日本を除く世界主要国の公社債の中から投資適格債を主要投資対象として運用を行います。

<海外債券マザーファンド>

日本を除く先進諸国の国債を中心とした各種投資適格債券に投資を行います。

- ・原則として投資適格([BBB-]格以上)の日本を除く世界主要国の国債、政府保証債、政府機関債、投資適格事業債、アセットバック証券、永久変動利付債、優先証券、モーゲージ証券、商業用モーゲージ証券といったセクターに分散投資します。
- ・FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)をベンチマークとして、アクティブ運用によりベンチマークを上回る投資成果をめざします。
- ・運用の指図に関する権限を、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・リミテッド(英国)^{*2}に委託します。

<新興国債券インデックスマザーファンド>

新興国の現地通貨建ての公社債に投資を行います。

- ・JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)をベンチマークとします。
- ・新興国の現地通貨建て国際機関債、および新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価額等が連動する債券に投資することがあります。
- ・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。

<グローバル社債ファンド T(適格機関投資家専用)>

グローバル社債マザーファンドへの投資を通じて、世界各国の社債に投資を行います。

- ・ブルームバーグ・グローバル総合社債インデックス(円ベース)をベンチマークとします。
- ・マザーファンドの運用の指図に係る権限を、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インク(米国)^{*1}およびモルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・リミテッド(英国)^{*2}に委託します。

モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメントはモルガン・スタンレーの資産運用部門として世界各国に展開し、様々な運用戦略を世界の投資家に提供しています。

*1 モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクは、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメントの米国拠点です。

*2 モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・リミテッドは、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメントの欧州拠点です。

! 運用の指図に関する権限の委託を受ける者、委託の内容、委託の有無等については、変更する場合があります。

■ 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。

特色

2

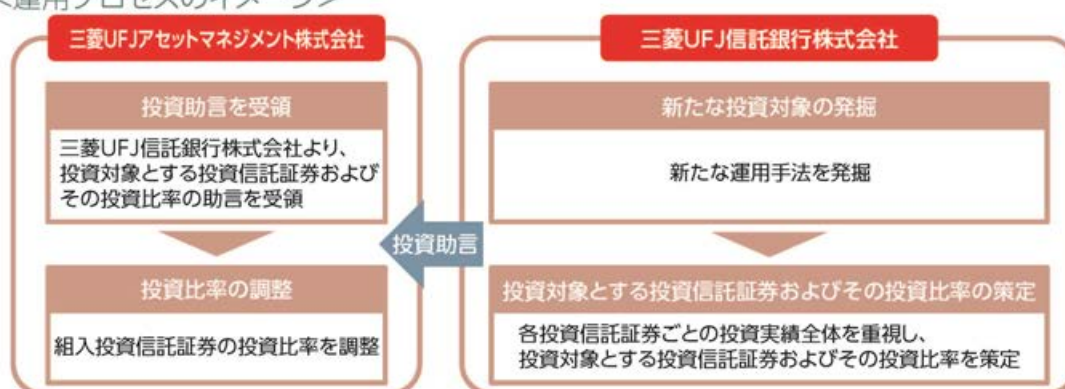
三菱UFJ信託銀行からの投資助言に基づき運用を行います。

- 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。

! 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、投資環境の変化等に応じて適宜変更します。

! 投資助言者、投資助言の内容、投資助言の有無等については、変更する場合があります。

＜運用プロセスのイメージ＞



! 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。

📄 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページでご覧いただけます。
(<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)

特色

3

原則として、為替ヘッジを行いません。

- 為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

特色

4

年1回の決算時(2月5日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。

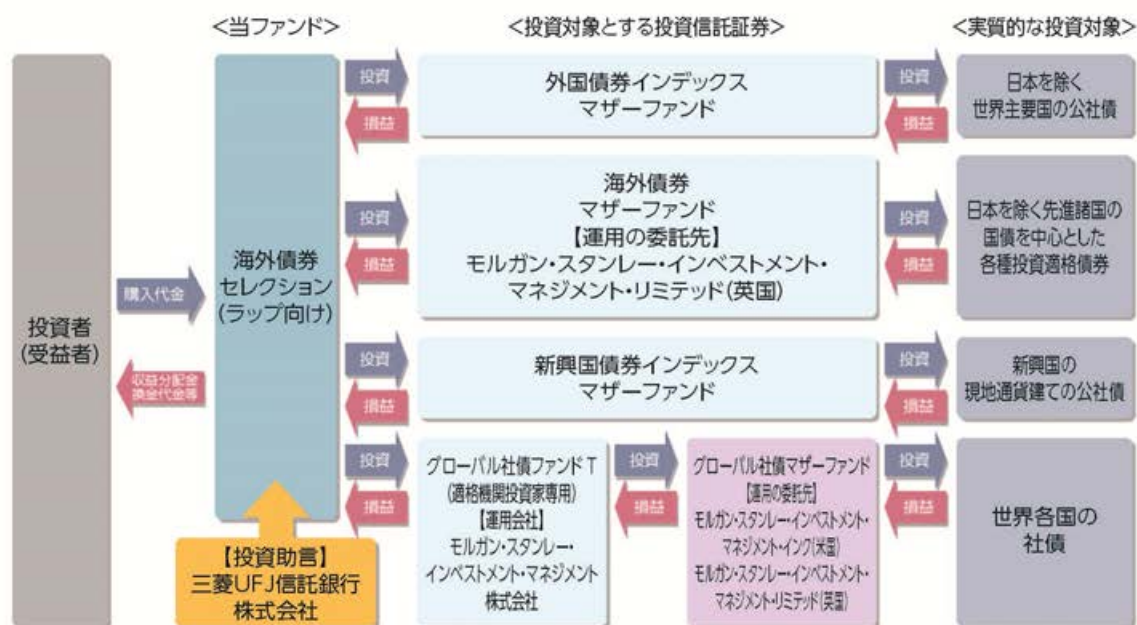
- 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ファンドの仕組み

ファンド・オブ・ファンズ方式により運用を行います。



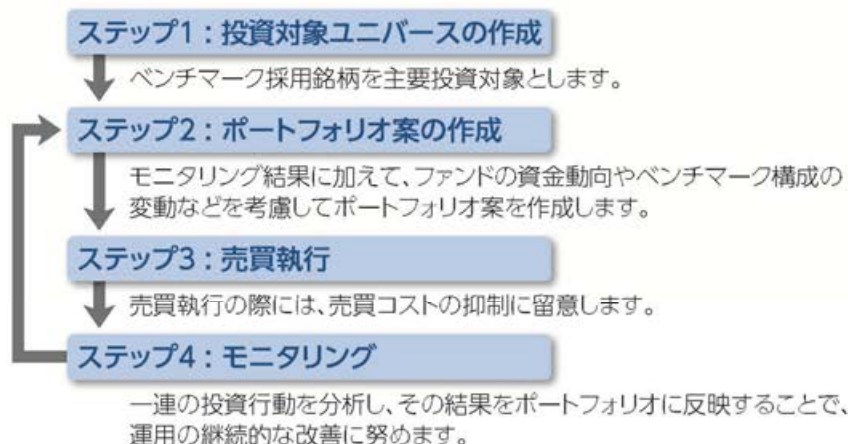
- 1 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。
- 2 上記の投資対象とする投資信託証券(および投資対象とする投資信託証券が投資するマザーファンドを含む)は、2024年5月3日現在のものであり、今後変更される場合があります。

■主な投資制限

株式	株式への直接投資は行いません。
投資信託証券	投資信託証券への投資割合に制限を設けません。
外貨建資産	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

■各投資信託証券の運用プロセス

<外国債券インデックスマザーファンド／新興国債券インデックスマザーファンド>



- 1 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。

<海外債券マザーファンド>

① トップダウンの価値評価

経済成長率、インフレ率等のマクロ経済状況、政治動向等も勘案した投資ユニバースのトップダウンの評価を行います。

② 定量的および定性的分析

マクロ戦略やセクター配分戦略構築のために徹底したファンダメンタルズ分析に加えて、定量ツールも活用します。

③ クレジット分析およびバリュエーション分析

ボトムアップの観点から、個別企業の競争優位性や財務状況等の分析を通じ、ビジネスリスク・財務リスク・経営陣等の評価を行います。また、投資候補の銘柄に関して個別に評価を実施し、マーケットにおける各々の銘柄の適正価格を導き出し、割安な状態かもしくは割高な状態かを判断します。

④ リスクマネジメント

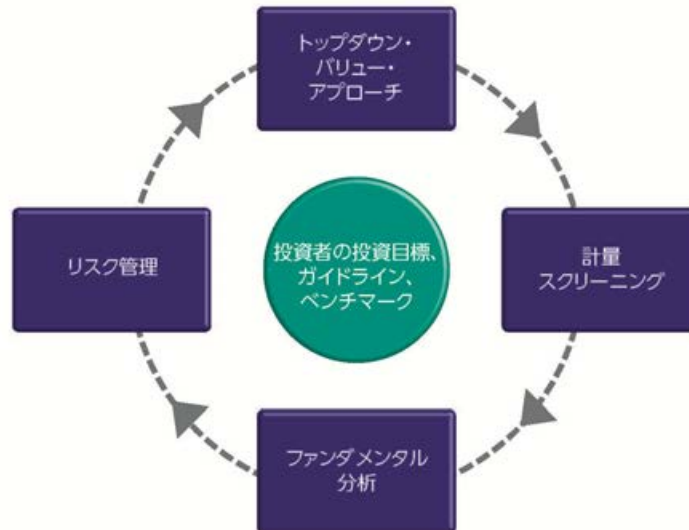
ポートフォリオの分散や流動性のある資産に投資することを通して、ポートフォリオが晒されるリスクの低減を目指します。



! 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。

<グローバル社債ファンド T(適格機関投資家専用)>

- ポートフォリオ構築プロセスのあらゆる局面において、当運用戦略の投資哲学であるバリュー・アプローチとリサーチ手法を採用します。
- 構築プロセスでは、計量モデルによるスクリーニングと、ファンダメンタルズ分析の双方を活用します。
- ポートフォリオ構築プロセスにおいて、リスク管理は非常に重要な過程となっています。



❗ 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。



指数について

・FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)は、FTSE世界国債インデックス(除く日本)・データに基づき委託会社が計算したものです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

・JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している現地通貨建ての新興国国債のパフォーマンスを表す指数で、指数構成国のウェイトに上限を設けた指数です。JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)とは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表しているJPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。同指数の情報は信頼性があると信じるに足る情報源から得られたものですが、J.P.モルガンはその完全性または正確性を保証するものではありません。同指数は使用許諾を得て使用しています。J.P.モルガンによる書面による事前の承諾なく同指数を複製、使用、頒布することは禁じられています。Copyright © 2017 J.P. Morgan Chase & Co. 無断複製・転載を禁じます。

・ブルームバーグ・グローバル総合社債インデックスとは、ブルームバーグが算出する世界の投資適格社債の値動きを表す指数です。ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社(以下「ブルームバーグ」と総称します。)のサービスマークです。ブルームバーグの指数はブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグは、ブルームバーグの指数に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性を保証するものではありません。

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。

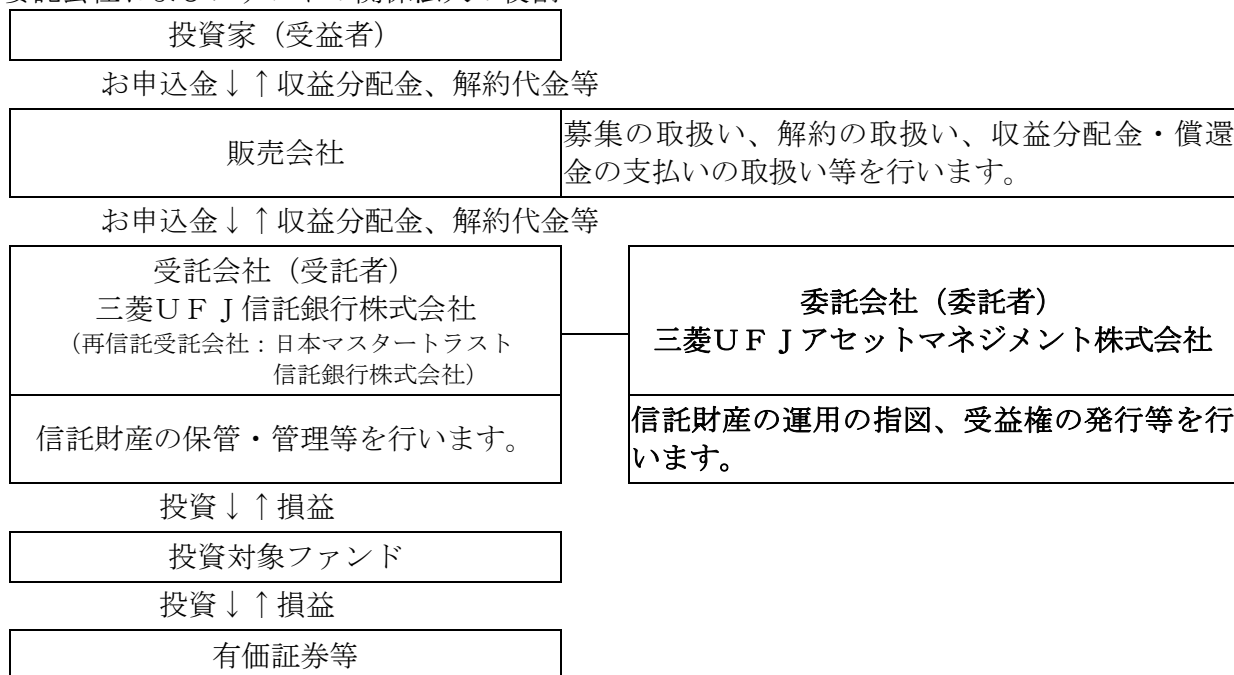
(2) 【ファンドの沿革】

2017年3月27日

設定日、信託契約締結、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

①委託会社およびファンドの関係法人の役割



②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 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	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。

③委託会社の概況（2024年4月1日現在）

- 金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- 設立年月日
1985年8月1日
- 資本金
2,000百万円
- 沿革

1997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
2004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
2005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
2015年7月	三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更
2023年10月	エム・ユー投資顧問株式会社の有価証券運用事業を三菱UFJ国際投信株式会社へ統合し、商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に

変更

・大株主の状況

株 主 名	住 所	所有株式数	所有比率
株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	211,581 株	100.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

投資信託証券を主要投資対象とします。

投資信託証券への投資を通じて、主として海外債券に実質的な投資を行います。

三菱UFJ信託銀行株式会社の助言に基づき、投資先ファンドの投資実績全体を重視し、ファンドを選定します。

投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。

投資信託証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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】

①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. 約束手形

ハ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

②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、別に定める投資信託証券（投資信託および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。）ならびに投資証券および外国投資証券（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。）をいいます。以下同じ。）のほか、次に掲げるものとします。

1. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（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の新株引受権証券を除きます。）

2. コマーシャル・ペーパー

3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、2. の証券の性質を有するもの

4. 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せん。）

なお、1. の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は短期社債等への投資ならびに買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができます。

③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
- ④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

<投資信託証券の概要>

外国債券インデックスマザーファンド	
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・主として対象インデックスに採用されている国債に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。 ・投資成果を対象インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。 ・公社債の実質投資比率(組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。)は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。 ・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。 ・組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引を行うことがあります。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)に採用されている国債
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、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割合は、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割合は、信託財産の純資産総額の5%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割合は、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割合は、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制限を設けません。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引を行うことができます。 ・外国為替予約取引を行うことができます。 ・デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ・外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	0.07%
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
設定日	2001年12月18日
決算日	原則として毎年5月12日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

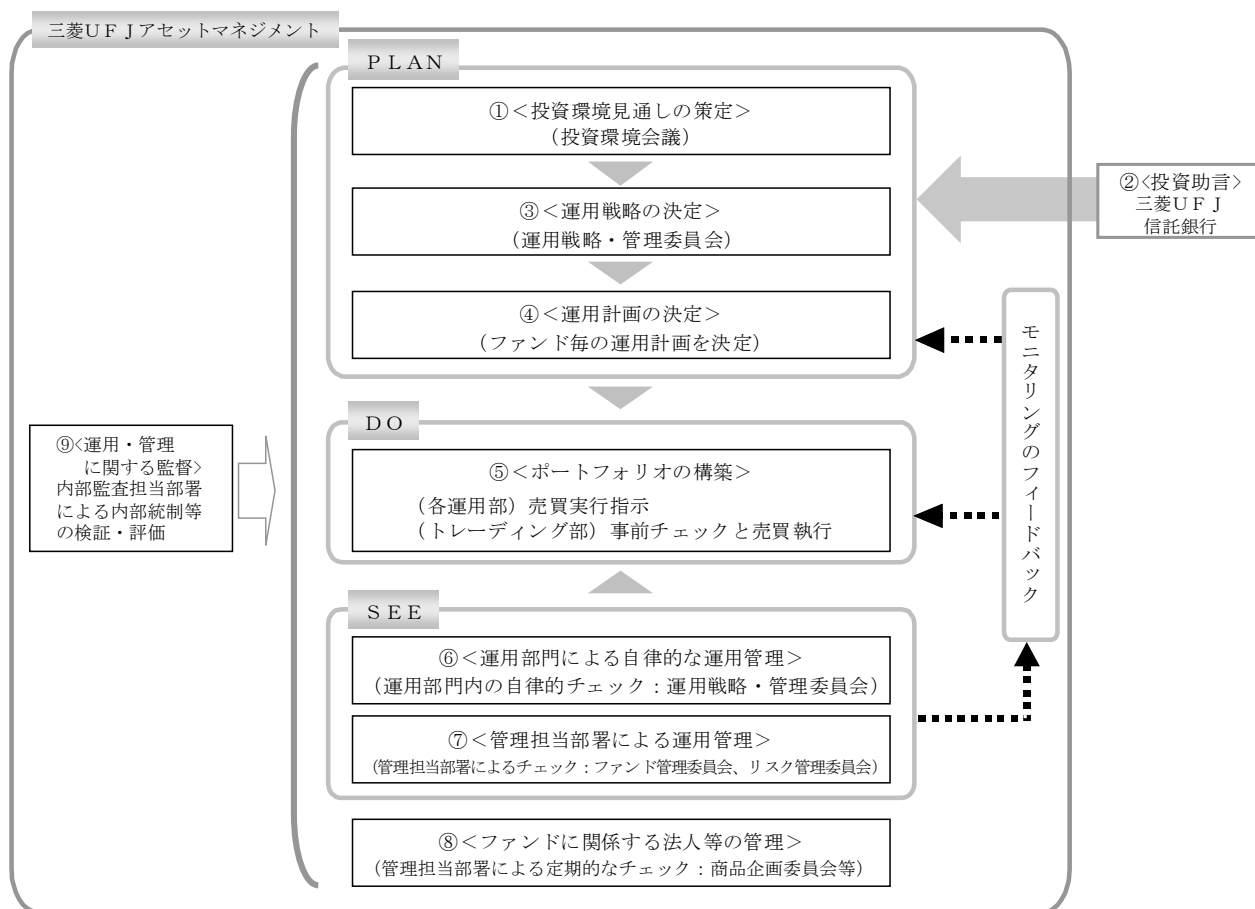
海外債券マザーファンド	
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・原則として投資適格(「BBB-」格以上)の日本を除く世界主要国の国債、政府保証債、政府機関債、投資適格事業債、アセットバック証券、永久変動利付債、優先証券、モーゲージ証券、商業用モーゲージ証券といったセクターに分散投資します。優先証券への投資にあたっては、債券の性格を有する証券のみに投資します。モーゲージ証券への投資にあたっては、IO、POといったリスクの高いレバレッジ型の証券には投資しません。 ・FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)をベンチマークとして、アクティブ運用によりベンチマークを上回る投資成果をめざします。 ・金利および為替見通しに基づいて国別投資配分、通貨配分および各国のデュレーションを策定します。投資する債券のセクターは主に米国を中心に各セクターに分散投資します。ファンドのデュレーションはベンチマークのデュレーションの±1.5年以内とし、デュレーションの調整に債券先物取引等を利用することがあります。 ・ファンド全体の組入公社債および債券先物取引等の建玉を合計した実質的な投資比率は、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・運用指図に関する権限は、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・リミテッドに委託します。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	日本を除く先進諸国の国債を中心とした各種投資適格債券
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、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割合は、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割合は、信託財産の純資産総額の5%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割合は、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割合は、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制限を設けません。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
設定日	1998年12月2日
決算日	原則として毎年7月22日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

新興国債券インデックスマザーファンド	
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・主として対象インデックスに採用されている新興国の現地通貨建の公社債に投資を行い、信託財産の100%当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。 ・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投資比率が100%を超える場合があります。 ・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。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引を行うことがあります。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	新興国の現地通貨建ての公社債
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、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割合は、信託財産の純資産総額の5%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割合は、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割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引を行うことができます。 ・金利先渡し取引、為替先渡し取引および直物為替先渡し取引を行うことができます。 ・外国為替予約取引を行うことができます。 ・デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ・外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	0.3%
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
設定日	2010年6月25日
決算日	原則として毎年1月26日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

グローバル社債ファンド T(適格機関投資家専用)	
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・グローバル社債マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として世界各国の社債に分散投資を行うことにより、安定した収益の確保および投資信託財産の長期的な成長を図ることを目指します。 ・当ファンドのベンチマークは、ブルームバーグ・グローバル総合社債インデックス(円ベース)とします。 ・実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 ・市況動向、資金動向、投資環境の変化等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
マザーファンドの投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・世界各国の社債を中心に分散投資を行うことにより、安定した収益の確保および投資信託財産の長期的な成長を図ることを目指します。 ・運用にあたっては、トップダウンによるマクロ分析等に加え、ボトムアップのファンダメンタルズ分析ならびに計量モデルを活用し、リスク管理を重視しつつ魅力的なリスク・リターン特性を有する社債への投資機会を追求します。 ・当ファンドのベンチマークは、ブルームバーグ・グローバル総合社債インデックス(円ベース)とします。 ・外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 ・運用の指図に係る権限を、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インク(米国)およびモルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・リミテッド(英国)に委託します。 ・市況動向、資金動向、投資環境の変化等により、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資対象	グローバル社債マザーファンド受益証券
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
運用管理費用(信託報酬)	純資産総額の年率0.374%以内(税抜 年率0.34%以内)
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	<ul style="list-style-type: none"> ・取得申込受付日の翌営業日の基準価額に0.05%を乗じた額 ・解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.05%を乗じた額
投資運用会社	モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント株式会社
設定日	2017年4月7日
決算日	原則として毎年9月5日
分配方針	収益の分配は行いません。

! 今後、上記の記載内容が変更となる場合があります。

(3) 【運用体制】



①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。

②投資助言

当ファンドは、三菱UFJ信託銀行（「助言元」といいます。）から運用戦略または運用計画の立案に資する投資助言を受けています。

③運用戦略の決定

運用戦略・管理委員会において、①で策定された投資環境見通し、および②の投資助言に沿って運用戦略を決定します。

④運用計画の決定

③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。

⑤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。

⑥運用部門による自律的な運用管理

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、運用部門内の管理担当部署は逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また、運用戦略・管理委員会を通じて運用状況のモニタリングを行い、運用部門内での自律的牽制により運用改善を図ります。

⑦管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、(a) 運用に関するパフォーマンス測定・分析のほか、(b) 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、(a) についてはファンド管理委員会を経て運用担当部・商品開発担当部にフィードバ

ックされ、(b) についてはリスク管理委員会を通じて運用担当部にフィードバックされ、必要に応じて部署間連携の上で是正・改善の検討が行われます。

⑧ファンドに關係する法人等の管理

助言元、受託会社等、ファンドの運営に關係する法人については、その業務に關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、商品企画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。

⑨運用・管理に關する監督

内部監査担当部署（10 名程度）は、運用、管理等に關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。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

なお、委託会社に關する「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページでご覧いただけます。

「運用担当者に係る事項」 <https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>

(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。

- ①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。
- ②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。
- ③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 >

①株式

株式への直接投資は行いません。

②投資信託証券

投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

③信用取引

信用取引の指図は行いません。

④外国為替予約取引

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、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。

⑤公社債の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. a. の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

⑥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。

⑦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。

⑧信用リスクの分散規制

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

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。

(主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。)

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、ファンドはその影響を受け組入公社債の価格の下落は基準価額の下落要因となります。
為替変動 リスク	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ので、為替変動の影響を大きく受けます。
信用リスク	組入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は、当該組入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・償還金の支払いが滞ることがあります。
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場合または取引が不可能となる場合、市場実勢から期待される価格より不利な価格での取引となる可能性があります。
カントリー・ リスク	新興国への投資は、先進国への投資を行う場合に比べ、投資対象国におけるクーデターや重大な政治体制の変更、資産凍結を含む重大な規制の導入、政府のデフォルト等の発生による影響を受けることにより、価格変動・為替変動・信用・流動性の各リスクが大きくなる可能性があります。

※留意事項

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第 37 条の 6 の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- ・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かつた場合も同様です。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。

（２）投資リスクに対する管理体制

委託会社では、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とともに運用部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い、ファンド管理委員会およびリスク管理委員会においてそれらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を検討しています。

また、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策を策定し流動性リスクの評価と管理プロセスの検証などを行います。リスク管理委員会は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

①コンプライアンス担当部署

法令上の禁止行為、約款の投資制限等のモニタリングを通じ、法令等遵守のための管理態勢の状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

②リスク管理担当部署

運用リスク全般の状況をモニタリング・管理するとともに、運用実績の分析および評価を行い、必要に応じて改善策等を提言します。また、事務・情報資産・その他のリスクの統括的管理を行っています。

③内部監査担当部署

委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

*組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。



- 基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
- ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI(国債)	NOMURA-BPI(国債)とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表しているわが国の代表的な国債パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(総合)のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本)	FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

※申込手数料の対価として提供する役務の内容は、ファンドおよび投資環境の説明・情報提供、購入に関する事務手続等です。

(2) 【換金（解約）手数料】

かかりません。

※換金（解約）手数料の対価として提供する役務の内容は、商品の換金に関する事務手続等です。

(3) 【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年 0.418%（税抜 0.38%）の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

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

※上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

- ・信託報酬は、毎計算期間の 6 ヶ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。
- ・信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.30%	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等
販売会社	0.04%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等
受託会社	0.04%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

※上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

受益者が負担する実質的な信託報酬率（概算値）は、次の通りとなります。

実質的な信託報酬率（概算値）	うち投資信託証券に係る率
年 0.418%～0.548%（税込）程度	年 0%～0.13%（税込）程度*

*ファンドが投資対象とする投資信託証券の信託報酬は最大年率 0.374%（税込）

（注）上記概算値は、投資対象とする投資信託証券における信託報酬率を含めた実質的な信託報酬率を算出したものです（2024 年 5 月 3 日現在）。各投資信託証券への投資比率が変動する可能性や投資信託証券の変更の可能性があること、また別途成功報酬がかかる投資信託証券が含まれる場合があることから、実質的な信託報酬率は変動します。したがって事前に固定の料率、上限額等を表示することはできません。

<投資信託証券の信託報酬率>

投資信託証券の名称	信託報酬率（税抜）
外国債券インデックスマザーファンド	—
海外債券マザーファンド	—

新興国債券インデックスマザーファンド	—
グローバル社債ファンド T（適格機関投資家専用）	年 0.34%以内

※上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかる場合があります。

上記の信託報酬率は、今後変更となる場合があります。上記の他、監査費用等の諸費用が別途かかります。申込手数料はかかりません。

（４）【その他の手数料等】

- ・信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、投資信託証券の取得・売却に伴う信託財産留保額、受託会社の立替えた立替金の利息、借入を行う場合の借入金の利息および借入れに関する品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ・信託財産に係る監査費用（消費税等相当額を含みます。）は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁します。支弁時期は信託報酬と同様です。
- ・信託財産（投資している投資信託を含みます。）の組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等（消費税等相当額を含みます。）、先物取引・オプション取引等に要する費用および外貨建資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担するものとします。

※売買条件等により異なるため、あらかじめ金額または上限額等を記載することはできません。

（注）手数料等については、保有金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等を記載することはできません。なお、ファンドが負担する費用（手数料等）の支払い実績は、交付運用報告書に開示されていますのでご参照ください。

（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。

①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、）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。

②法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

※分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

◇個別元本について

- ①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。
- ②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。
- ③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、①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、②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 2024 年 2 月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

（参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間（以下「当期間」といいます。）（2023年2月7日～2024年2月5日）における当ファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
0.56%	0.54%	0.02%

（比率は年率、表示桁数未満四捨五入）

※当期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。消費税等のかかるものは消費税等を含む。）を当期間の平均受益権口数に平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除しています。

※①の運用管理費用には投資先ファンドの運用管理費用を含みます。

※投資先ファンドの費用は対象期間が異なる場合があります。

※入手し得る情報において含まれていない費用はありません。

詳細につきましては、当期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

5 【運用状況】

【海外債券セレクション（ラップ向け）】

（1）【投資状況】

2024 年 2 月 29 日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	8,109,444,201	31.22
親投資信託受益証券	日本	17,328,217,906	66.72
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	535,737,974	2.06
純資産総額		25,973,400,081	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】

①【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位３０銘柄

2024年２月29日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	5,794,847,787	2.5977	15,053,276,096	2.6132	15,143,096,236	58.30
日本	投資信託受益証券	グローバル社債ファンド T（適格機関投資家専用）	5,249,850,587	1.5286	8,024,921,607	1.5447	8,109,444,201	31.22
日本	親投資信託受益証券	海外債券マザーファンド	421,263,769	2.9370	1,237,251,689	2.9537	1,244,286,794	4.79
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックスマザーファンド	521,700,608	1.7852	931,339,925	1.8034	940,834,876	3.62

（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

2024年２月29日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	31.22
親投資信託受益証券	66.72
合計	97.94

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

①【純資産の推移】

下記計算期間末日および2024年２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)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第 1 計算期間末日	(2018 年 2 月 5 日)	3, 009, 456, 455	3, 009, 456, 455	10, 690	10, 690
第 2 計算期間末日	(2019 年 2 月 5 日)	5, 700, 012, 642	5, 700, 012, 642	10, 410	10, 410
第 3 計算期間末日	(2020 年 2 月 5 日)	6, 384, 502, 081	6, 384, 502, 081	11, 178	11, 178
第 4 計算期間末日	(2021 年 2 月 5 日)	8, 265, 751, 243	8, 265, 751, 243	11, 579	11, 579
第 5 計算期間末日	(2022 年 2 月 7 日)	14, 001, 523, 663	14, 001, 523, 663	11, 855	11, 855
第 6 計算期間末日	(2023 年 2 月 6 日)	20, 928, 440, 554	20, 928, 440, 554	11, 861	11, 861
第 7 計算期間末日	(2024 年 2 月 5 日)	25, 881, 579, 252	25, 881, 579, 252	13, 623	13, 623
	2023 年 2 月末日	21, 030, 166, 070	—	11, 879	—
	3 月末日	21, 337, 056, 361	—	11, 935	—
	4 月末日	21, 911, 452, 110	—	12, 095	—
	5 月末日	22, 452, 966, 207	—	12, 396	—
	6 月末日	23, 465, 892, 372	—	12, 919	—
	7 月末日	23, 007, 486, 856	—	12, 617	—
	8 月末日	24, 020, 567, 290	—	12, 988	—
	9 月末日	23, 928, 498, 234	—	12, 839	—
	10 月末日	23, 984, 932, 630	—	12, 801	—
	11 月末日	25, 061, 151, 589	—	13, 231	—
	12 月末日	25, 293, 352, 844	—	13, 292	—
	2024 年 1 月末日	25, 680, 298, 954	—	13, 547	—
	2 月末日	25, 973, 400, 081	—	13, 720	—

②【分配の推移】

	1 万口当たりの分配金
第 1 計算期間	0 円
第 2 計算期間	0 円
第 3 計算期間	0 円
第 4 計算期間	0 円
第 5 計算期間	0 円
第 6 計算期間	0 円
第 7 計算期間	0 円

③【収益率の推移】

	収益率 (%)
第 1 計算期間	6. 90
第 2 計算期間	△2. 61
第 3 計算期間	7. 37

第 4 計算期間	3. 58
第 5 計算期間	2. 38
第 6 計算期間	0. 05
第 7 計算期間	14. 85

（注）「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額）を控除した額を当該基準価額（分配落の額）で除して得た数に 100 を乗じて得た数をいう。

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第 1 計算期間	3, 292, 072, 816	476, 809, 034	2, 815, 263, 782
第 2 計算期間	3, 398, 317, 842	738, 325, 776	5, 475, 255, 848
第 3 計算期間	1, 397, 735, 796	1, 161, 172, 972	5, 711, 818, 672
第 4 計算期間	3, 343, 221, 903	1, 916, 573, 896	7, 138, 466, 679
第 5 計算期間	6, 169, 114, 566	1, 497, 145, 972	11, 810, 435, 273
第 6 計算期間	8, 626, 815, 259	2, 793, 017, 996	17, 644, 232, 536
第 7 計算期間	5, 688, 995, 068	4, 335, 427, 895	18, 997, 799, 709

（参考）

外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

2024 年 2 月 29 日現在
（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	254, 559, 959, 974	46. 34
	中国	45, 909, 629, 545	8. 36
	フランス	44, 012, 598, 625	8. 01
	イタリア	39, 753, 850, 281	7. 24
	ドイツ	34, 261, 579, 172	6. 24
	イギリス	28, 254, 058, 792	5. 14
	スペイン	26, 530, 063, 651	4. 83
	カナダ	10, 717, 007, 634	1. 95
	ベルギー	9, 308, 371, 285	1. 69
	オランダ	7, 809, 724, 124	1. 42
	オーストラリア	7, 259, 809, 554	1. 32
	オーストリア	6, 457, 965, 995	1. 18
	メキシコ	4, 671, 927, 723	0. 85
	アイルランド	3, 103, 723, 344	0. 57
	ポーランド	2, 752, 416, 839	0. 50
	フィンランド	2, 739, 510, 531	0. 50

	マレーシア	2, 709, 061, 248	0. 49
	シンガポール	2, 197, 031, 200	0. 40
	イスラエル	1, 807, 862, 449	0. 33
	デンマーク	1, 411, 500, 477	0. 26
	ニュージーランド	1, 224, 988, 642	0. 22
	スウェーデン	1, 038, 108, 052	0. 19
	ノルウェー	851, 293, 427	0. 15
小計		539, 342, 042, 564	98. 18
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	9, 975, 043, 796	1. 82
純資産総額		549, 317, 086, 360	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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

2024 年 2 月 29 日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	4. 5 T-NOTE 331115	17, 650, 000	15, 545. 98	2, 743, 866, 291	15, 323. 60	2, 704, 617, 134	4. 500000	2033/11/15	0. 49
アメリカ	国債証券	3. 875 T-NOTE 330815	16, 640, 000	14, 319. 64	2, 382, 788, 328	14, 591. 44	2, 428, 016, 916	3. 875000	2033/8/15	0. 44
アメリカ	国債証券	4. 125 T-NOTE 321115	16, 070, 000	15, 891. 32	2, 553, 735, 427	14, 886. 31	2, 392, 230, 606	4. 125000	2032/11/15	0. 44
アメリカ	国債証券	3. 375 T-NOTE 330515	16, 100, 000	14, 503. 58	2, 335, 077, 101	14, 031. 73	2, 259, 108, 894	3. 375000	2033/5/15	0. 41
アメリカ	国債証券	1. 25 T-NOTE 310815	17, 720, 000	12, 816. 95	2, 271, 164, 495	12, 181. 90	2, 158, 633, 538	1. 250000	2031/8/15	0. 39
アメリカ	国債証券	3. 5 T-NOTE 330215	15, 100, 000	15, 200. 01	2, 295, 202, 004	14, 190. 05	2, 142, 698, 091	3. 500000	2033/2/15	0. 39
アメリカ	国債証券	1. 875 T-NOTE 320215	16, 860, 000	13, 286. 18	2, 240, 050, 366	12, 633. 32	2, 129, 978, 819	1. 875000	2032/2/15	0. 39
アメリカ	国債証券	0. 875 T-NOTE 301115	17, 430, 000	12, 645. 32	2, 204, 079, 560	12, 117. 16	2, 112, 021, 667	0. 875000	2030/11/15	0. 38
アメリカ	国債証券	2. 875 T-NOTE 320515	15, 480, 000	14, 460. 86	2, 238, 542, 179	13, 599. 14	2, 105, 147, 573	2. 875000	2032/5/15	0. 38
アメリカ	国債証券	1. 625 T-NOTE 310515	16, 640, 000	13, 256. 57	2, 205, 894, 259	12, 615. 37	2, 099, 198, 483	1. 625000	2031/5/15	0. 38
アメリカ	国債証券	1. 125 T-NOTE 310215	16, 920, 000	12, 719. 72	2, 152, 177, 361	12, 278. 42	2, 077, 510, 010	1. 125000	2031/2/15	0. 38
アメリカ	国債証券	2. 75 T-NOTE 320815	15, 460, 000	14, 195. 61	2, 194, 641, 545	13, 430. 22	2, 076, 313, 472	2. 750000	2032/8/15	0. 38
アメリカ	国債証券	1. 375 T-NOTE 311115	16, 600, 000	12, 856. 09	2, 134, 111, 576	12, 213. 39	2, 027, 423, 172	1. 375000	2031/11/15	0. 37
アメリカ	国債証券	0. 625 T-NOTE 300815	16, 160, 000	12, 412. 42	2, 005, 847, 822	11, 984. 44	1, 936, 686, 292	0. 625000	2030/8/15	0. 35
フランス	国債証券	2. 75 O. A. T 271025	10, 320, 000	16, 481. 32	1, 700, 872, 885	16, 295. 28	1, 681, 673, 774	2. 750000	2027/10/25	0. 31
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 250815	11, 490, 000	14, 485. 50	1, 664, 384, 865	14, 472. 26	1, 662, 863, 297	2. 000000	2025/8/15	0. 30
アメリカ	国債証券	4. 75 T-BOND 531115	10, 240, 000	16, 221. 00	1, 661, 031, 250	15, 936. 88	1, 631, 936, 904	4. 750000	2053/11/15	0. 30

アメリカ	国債証券	1. 25 T-NOTE 261130	11,360,000	13,895.90	1,578,575,198	13,823.97	1,570,403,276	1.250000	2026/11/30	0.29
フランス	国債証券	2. 5 O. A. T 300525	9,590,000	16,254.67	1,558,823,035	16,091.72	1,543,196,636	2.500000	2030/5/25	0.28
アメリカ	国債証券	4 T-NOTE 290131	10,050,000	15,095.93	1,517,141,271	14,883.37	1,495,778,778	4.000000	2029/1/31	0.27
アメリカ	国債証券	2. 25 T-NOTE 251115	10,290,000	14,540.24	1,496,191,057	14,455.78	1,487,500,369	2.250000	2025/11/15	0.27
フランス	国債証券	0. 75 O. A. T 280525	9,750,000	14,939.17	1,456,569,883	15,030.23	1,465,447,581	0.750000	2028/5/25	0.27
アメリカ	国債証券	2. 875 T-NOTE 280815	10,310,000	14,620.02	1,507,325,060	14,188.58	1,462,842,818	2.875000	2028/8/15	0.27
アメリカ	国債証券	0. 625 T-NOTE 300515	12,090,000	12,522.67	1,513,991,774	12,083.32	1,460,873,637	0.625000	2030/5/15	0.27
アメリカ	国債証券	4. 375 T-NOTE 261215	9,640,000	15,161.01	1,461,522,003	15,031.68	1,449,054,598	4.375000	2026/12/15	0.26
アメリカ	国債証券	1. 125 T-NOTE 261031	10,450,000	13,867.31	1,449,134,857	13,805.13	1,442,636,999	1.125000	2026/10/31	0.26
アメリカ	国債証券	0. 25 T-NOTE 251031	10,300,000	13,846.63	1,426,203,087	13,987.59	1,440,721,850	0.250000	2025/10/31	0.26
アメリカ	国債証券	4. 125 T-BOND 530815	10,020,000	13,911.92	1,393,974,866	14,340.72	1,436,940,503	4.125000	2053/8/15	0.26
アメリカ	国債証券	5 T-NOTE 251031	9,500,000	15,098.68	1,434,374,634	15,122.32	1,436,620,801	5.000000	2025/10/31	0.26
アメリカ	国債証券	2. 875 T-NOTE 280515	10,090,000	14,685.57	1,481,775,006	14,228.01	1,435,606,748	2.875000	2028/5/15	0.26

（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

2024 年 2 月 29 日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.18
合計	98.18

（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。

海外債券マザーファンド

投資状況

2024 年 2 月 29 日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	2,273,737,872	51.67
	イタリア	285,890,565	6.50
	イギリス	202,977,191	4.61
	スペイン	171,975,219	3.91

	フランス	155, 443, 466	3. 53
	ドイツ	123, 823, 254	2. 81
	ベルギー	54, 459, 121	1. 24
	フィンランド	51, 642, 768	1. 17
	メキシコ	43, 830, 626	1. 00
	オーストラリア	39, 617, 968	0. 90
	ポーランド	31, 738, 755	0. 72
	エストニア	27, 048, 808	0. 61
	ラトビア	23, 358, 694	0. 53
	ルクセンブルグ	22, 729, 885	0. 52
	シンガポール	19, 437, 375	0. 44
	オランダ	18, 333, 573	0. 42
	ギリシャ	17, 756, 799	0. 40
	インドネシア	15, 401, 462	0. 35
	アイスランド	14, 133, 287	0. 32
	中国	13, 413, 567	0. 30
	リトアニア	12, 239, 205	0. 28
	オーストリア	12, 009, 405	0. 27
	スロベニア	11, 434, 944	0. 26
	ニュージーランド	10, 130, 640	0. 23
	デンマーク	10, 048, 198	0. 23
	ハンガリー	4, 997, 744	0. 11
	小計	3, 667, 610, 391	83. 34
地方債証券	ドイツ	11, 573, 832	0. 26
特殊債券	アメリカ	86, 450, 829	1. 96
	イギリス	47, 459, 217	1. 08
	ドイツ	42, 481, 619	0. 97
	フランス	42, 077, 589	0. 96
	オーストラリア	26, 417, 369	0. 60
	ルクセンブルグ	20, 572, 646	0. 47
	スペイン	16, 122, 488	0. 37
	小計	281, 581, 757	6. 40
社債券	アメリカ	172, 777, 996	3. 93
	フランス	65, 273, 624	1. 48
	イギリス	55, 520, 019	1. 26
	オランダ	31, 987, 974	0. 73
	スペイン	15, 961, 867	0. 36
	アイルランド	15, 370, 428	0. 35
	ドイツ	8, 074, 377	0. 18
	小計	364, 966, 285	8. 29
コール・ローン、その他資産	—	74, 936, 938	1. 71

(負債控除後)			
純資産総額		4, 400, 669, 203	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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 3 0 銘柄

2024 年 2 月 29 日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	2. 125 T-NOTE 250515	3, 710, 000	14, 356. 96	532, 643, 404	14, 578. 20	540, 851, 414	2. 125000	2025/5/15	12. 29
アメリカ	国債証券	1. 125 T-NOTE 261031	2, 200, 000	13, 610. 37	299, 428, 224	13, 805. 13	303, 713, 052	1. 125000	2026/10/31	6. 90
アメリカ	国債証券	0. 5 T-NOTE 270430	1, 970, 000	13, 105. 64	258, 181, 138	13, 341. 65	262, 830, 543	0. 500000	2027/4/30	5. 97
アメリカ	国債証券	1. 375 T-NOTE 311115	1, 945, 000	12, 278. 60	238, 818, 891	12, 213. 39	237, 550, 485	1. 375000	2031/11/15	5. 40
アメリカ	国債証券	1. 5 T-NOTE 300215	1, 470, 000	12, 819. 42	188, 445, 617	12, 877. 87	189, 304, 701	1. 500000	2030/2/15	4. 30
イタリア	国債証券	1. 2 ITALY GOVT 250815	832, 000	15, 538. 36	129, 279, 168	15, 816. 91	131, 596, 708	1. 200000	2025/8/15	2. 99
アメリカ	国債証券	0. 5 T-NOTE 270630	965, 000	13, 040. 48	125, 840, 714	13, 264. 84	128, 005, 758	0. 500000	2027/6/30	2. 91
アメリカ	国債証券	1. 25 T-NOTE 280331	940, 000	13, 419. 61	126, 144, 336	13, 339. 88	125, 394, 929	1. 250000	2028/3/31	2. 85
アメリカ	国債証券	2. 5 T-BOND 450215	1, 085, 000	11, 564. 51	125, 474, 944	10, 869. 72	117, 936, 486	2. 500000	2045/2/15	2. 68
アメリカ	国債証券	3. 375 T-BOND 420815	750, 000	13, 590. 02	101, 925, 163	12, 831. 66	96, 237, 518	3. 375000	2042/8/15	2. 19
ドイツ	国債証券	0. 25 BUND 290215	620, 000	14, 441. 84	89, 539, 442	14, 681. 21	91, 023, 543	0. 250000	2029/2/15	2. 07
アメリカ	国債証券	1. 125 T-BOND 400515	875, 000	9, 709. 68	84, 959, 706	9, 254. 72	80, 978, 871	1. 125000	2040/5/15	1. 84
イタリア	国債証券	0. 95 ITALY GOVT 300801	540, 000	13, 514. 65	72, 979, 117	13, 948. 89	75, 324, 040	0. 950000	2030/8/1	1. 71
イギリス	国債証券	0. 375 GILT 301022	475, 000	14, 564. 69	69, 182, 278	15, 053. 22	71, 502, 828	0. 375000	2030/10/22	1. 62
フランス	国債証券	0 0. A. T 260225	410, 000	15, 440. 02	63, 304, 089	15, 396. 20	63, 124, 442	0. 000000	2026/2/25	1. 43
スペイン	国債証券	1. 6 SPAIN GOVT 250430	380, 000	15, 846. 66	60, 217, 342	15, 999. 15	60, 796, 781	1. 600000	2025/4/30	1. 38
イギリス	国債証券	3. 5 GILT 450122	360, 000	16, 500. 62	59, 402, 242	16, 209. 11	58, 352, 798	3. 500000	2045/1/22	1. 33
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 240531	310, 000	14, 642. 11	45, 390, 543	14, 940. 64	46, 316, 005	2. 000000	2024/5/31	1. 05
アメリカ	国債証券	3. 125 T-BOND 480515	380, 000	12, 866. 68	48, 893, 414	11, 905. 57	45, 241, 197	3. 125000	2048/5/15	1. 03
イギリス	国債証券	4. 625 GILT 340131	160, 000	19, 973. 05	31, 956, 882	19, 752. 06	31, 603, 300	4. 625000	2034/1/31	0. 72
オースト ラリア	国債証券	0. 5 AUST GOVT 260921	350, 000	8, 795. 42	30, 784, 004	9, 024. 24	31, 584, 848	0. 500000	2026/9/21	0. 72
フィンラ ンド	国債証券	3 FINNISH GOVT 330915	190, 000	16, 309. 89	30, 988, 809	16, 450. 97	31, 256, 843	3. 000000	2033/9/15	0. 71
ドイツ	特殊債券	2 KFW 291115	200, 000	15, 390. 79	30, 781, 588	15, 613. 29	31, 226, 591	2. 000000	2029/11/15	0. 71
アメリカ	特殊債券	2. 375 EXIM BK KO 240625	200, 000	14, 640. 22	29, 280, 441	14, 916. 10	29, 832, 208	2. 375000	2024/6/25	0. 68
アメリカ	国債証券	4. 5 MEXICO 290422	200, 000	14, 702. 20	29, 404, 405	14, 498. 95	28, 997, 903	4. 500000	2029/4/22	0. 66
アメリカ	国債証券	4. 25 T-BOND 401115	195, 000	15, 152. 99	29, 548, 344	14, 674. 72	28, 615, 720	4. 250000	2040/11/15	0. 65
アメリカ	特殊債券	3. 875 EX-IM BK IN 280201	200, 000	14, 212. 59	28, 425, 183	14, 302. 72	28, 605, 452	3. 875000	2028/2/1	0. 65

アメリカ	国債証券	1. 25 T-BOND 500515	370,000	7,943.32	29,390,293	7,597.06	28,109,135	1.250000	2050/5/15	0.64
アメリカ	特殊債券	3. 5 SAUDI ARABIAN 290416	200,000	13,992.30	27,984,602	14,006.58	28,013,169	3.500000	2029/4/16	0.64
フランス	国債証券	1. 25 O. A. T 360525	210,000	12,668.20	26,603,220	13,328.38	27,989,604	1.250000	2036/5/25	0.64

（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

2024 年 2 月 29 日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	83.34
地方債証券	0.26
特殊債券	6.40
社債券	8.29
合計	98.30

（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。

新興国債券インデックスマザーファンド

投資状況

2024 年 2 月 29 日現在

(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	メキシコ	8,716,711,412	9.74
	ブラジル	8,684,008,940	9.71
	タイ	8,675,974,761	9.70
	中国	8,664,317,159	9.69
	インドネシア	8,639,204,919	9.66
	マレーシア	8,605,390,006	9.62
	南アフリカ	6,953,378,821	7.77
	ポーランド	6,841,713,673	7.65
	チェコ	5,382,642,825	6.02
	コロンビア	3,901,888,861	4.36
	ルーマニア	3,392,540,006	3.79
	ハンガリー	2,618,041,886	2.93
	ペルー	1,878,343,847	2.10
	チリ	1,522,461,530	1.70

	トルコ	742, 492, 406	0. 83
	セルビア	250, 067, 831	0. 28
	ウルグアイ	157, 752, 150	0. 18
	ドミニカ共和国	140, 789, 430	0. 16
	小計	85, 767, 720, 463	95. 88
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	3, 682, 440, 628	4. 12
純資産総額		89, 450, 161, 091	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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 3 0 銘柄

2024 年 2 月 29 日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
ブラジル	国債証券	BRAZIL-LTN 260701	56, 800, 000	2, 413. 92	1, 371, 109, 976	2, 425. 97	1, 377, 952, 160	—	2026/7/1	1. 54
ブラジル	国債証券	BRAZIL-LTN 260101	52, 700, 000	2, 530. 70	1, 333, 679, 640	2, 546. 41	1, 341, 958, 945	—	2026/1/1	1. 50
ブラジル	国債証券	10 (IN) BRAZIL NTN 290101	42, 300, 000	3, 019. 50	1, 277, 250, 406	3, 027. 41	1, 280, 595, 292	10. 000000	2029/1/1	1. 43
ブラジル	国債証券	10 (IN)BRAZIL NT 270101	40, 270, 000	3, 054. 75	1, 230, 149, 822	3, 070. 60	1, 236, 532, 528	10. 000000	2027/1/1	1. 38
メキシコ	国債証券	5. 75 MEXICAN BONO 260305	120, 200, 000	814. 11	978, 569, 014	813. 09	977, 342, 480	5. 750000	2026/3/5	1. 09
南アフリ カ	国債証券	8 SOUTH AFRICA 300131	135, 300, 000	721. 56	976, 278, 663	707. 78	957, 628, 031	8. 000000	2030/1/31	1. 07
南アフリ カ	国債証券	10. 5 SOUTH AFRICA 261221	112, 600, 000	816. 52	919, 406, 819	809. 46	911, 460, 349	10. 500000	2026/12/21	1. 02
ブラジル	国債証券	BRAZIL-LTN 250701	33, 300, 000	2, 652. 34	883, 231, 124	2, 673. 71	890, 347, 456	—	2025/7/1	1. 00
メキシコ	国債証券	7. 75 MEXICAN BONO 310529	108, 500, 000	813. 33	882, 463, 381	814. 15	883, 362, 341	7. 750000	2031/5/29	0. 99
チェコ	国債証券	0. 25 CZECH REPUB 270210	143, 500, 000	579. 29	831, 293, 657	585. 16	839, 707, 343	0. 250000	2027/2/10	0. 94
マレーシ ア	国債証券	3. 885 MALAYSIAGOV 290815	26, 250, 000	3, 196. 13	838, 984, 583	3, 187. 87	836, 817, 344	3. 885000	2029/8/15	0. 94
ブラジル	国債証券	10 (IN)BRAZIL NTN 250101	26, 900, 000	3, 046. 40	819, 481, 621	3, 070. 50	825, 966, 875	10. 000000	2025/1/1	0. 92
南アフリ カ	国債証券	8. 75 SOUTH AFRICA 480228	146, 200, 000	574. 42	839, 810, 081	563. 53	823, 881, 664	8. 750000	2048/2/28	0. 92
メキシコ	国債証券	7. 5 MEXICAN BONOS 270603	98, 200, 000	835. 03	820, 008, 965	834. 75	819, 731, 988	7. 500000	2027/6/3	0. 92
南アフリ カ	国債証券	8. 25 SOUTH AFRICA 320331	122, 700, 000	681. 90	836, 693, 956	667. 67	819, 239, 556	8. 250000	2032/3/31	0. 92
マレーシ ア	国債証券	3. 955 MALAYSIAGOV 250915	25, 600, 000	3, 188. 26	816, 195, 287	3, 184. 49	815, 229, 924	3. 955000	2025/9/15	0. 91
チェコ	国債証券	6 CZECH REPUBLIC 260226	118, 500, 000	675. 21	800, 123, 963	675. 09	799, 993, 445	6. 000000	2026/2/26	0. 89
チェコ	国債証券	5. 5 CZECH REPUBLI 281212	108, 000, 000	694. 98	750, 587, 148	698. 69	754, 594, 461	5. 500000	2028/12/12	0. 84
南アフリ カ	国債証券	8. 875 SOUTH AFRIC 350228	114, 500, 000	658. 95	754, 505, 160	646. 12	739, 808, 888	8. 875000	2035/2/28	0. 83

ポーランド	国債証券	7.5 POLAND 280725	17,000,000	4,128.52	701,849,113	4,122.85	700,884,780	7.500000	2028/7/25	0.78
メキシコ	国債証券	5.5 MEXICAN BONOS 270304	86,200,000	788.85	679,991,521	790.21	681,165,387	5.500000	2027/3/4	0.76
南アフリカ	国債証券	8.5 SOUTH AFRICA 370131	110,940,000	609.84	676,564,921	598.24	663,694,112	8.500000	2037/1/31	0.74
チェコ	国債証券	1.75 CZECH REPUBL 320623	117,200,000	548.18	642,469,714	555.01	650,478,842	1.750000	2032/6/23	0.73
メキシコ	国債証券	8.5 MEXICAN BONOS 290531	75,100,000	859.04	645,139,600	856.27	643,064,398	8.500000	2029/5/31	0.72
ポーランド	国債証券	2.75 POLAND 291025	19,200,000	3,349.42	643,089,012	3,344.16	642,080,534	2.750000	2029/10/25	0.72
ブラジル	国債証券	BRAZIL-LTN 270701	29,200,000	2,181.37	636,961,667	2,188.61	639,074,644	—	2027/7/1	0.71
メキシコ	国債証券	7.75 MEXICAN BONO 421113	83,600,000	755.39	631,509,204	754.55	630,806,151	7.750000	2042/11/13	0.71
マレーシア	国債証券	2.632 MALAYSIA GOV 310415	21,200,000	2,939.62	623,199,628	2,923.88	619,864,385	2.632000	2031/4/15	0.69
ブラジル	国債証券	10 (IN) BRAZIL NTN 330101	20,700,000	2,954.82	611,648,704	2,959.95	612,711,674	10.000000	2033/1/1	0.68
チェコ	国債証券	0.05 CZECH REPUBL 291129	116,000,000	521.85	605,356,601	527.69	612,129,618	0.050000	2029/11/29	0.68

（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

2024 年 2 月 29 日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	95.88
合計	95.88

（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。

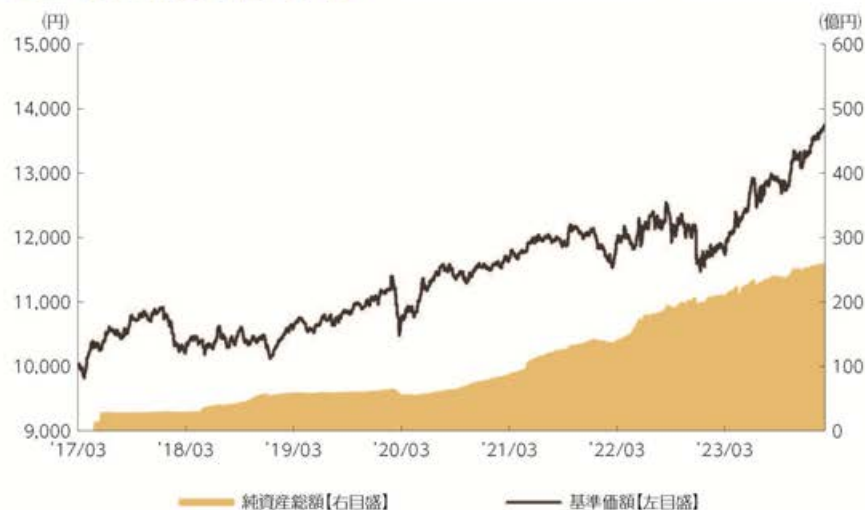
《参考情報》



運用実績

2024年2月29日現在

■基準価額・純資産の推移 2017年3月27日(設定日)～2024年2月29日



■基準価額・純資産

基準価額	13,720円
純資産総額	259.7億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2024年2月	0円
2023年2月	0円
2022年2月	0円
2021年2月	0円
2020年2月	0円
2019年2月	0円
設定来累計	0円

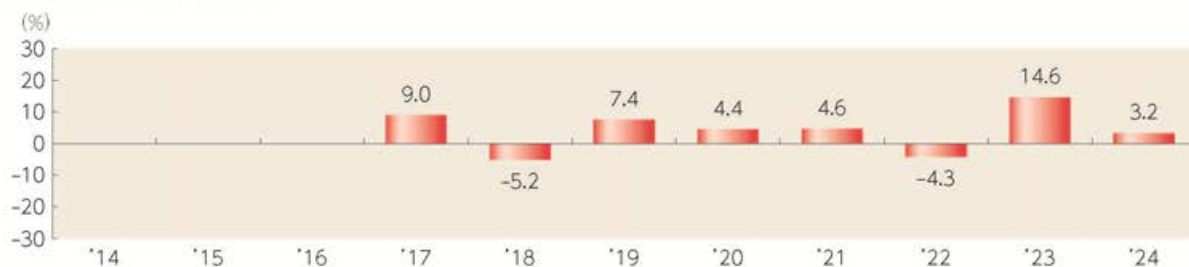
●分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

組入上位銘柄	比率
1 外国債券インデックスマザーファンド	58.3%
2 グローバル社債ファンドT(適格機関投資家専用)	31.2%
3 海外債券マザーファンド	4.8%
4 新興国債券インデックスマザーファンド	3.6%

●比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2017年は設定日から年末までの、2024年は年初から2月29日までの収益率を表示
- ファンドにベンチマークはありません。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。
運用状況等は、委託会社のホームページ等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】

①申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

ただし、以下の日は申込みできません。

ニューヨーク証券取引所の休業日の前営業日

ニューヨークの銀行の休業日の前営業日

ロンドン証券取引所の休業日の前営業日

ロンドンの銀行の休業日の前営業日

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。

②申込単位

販売会社が定める単位

③申込価額

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額

④申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑤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アセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：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 <https://www.am.mufg.jp/>

⑥申込手数料

ありません。

⑦申込方法

取得申込者は、販売会社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）があります。申込みコースの取扱いの販売会社により異なる場合があります。

⑧申込受付時間

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。

ただし、2024年11月5日以降は、以下の通りとなります。

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後3時30分までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。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。

⑨取得申込みの受付の中止および取消し

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（投資対象証券の取得の制限、投資対象国・地域における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）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の受付を取り消すことがあります。

また、信託金の限度額に達しない場合でも、ファンドの運用規模・運用効率等を勘案し、市況動向や資金流入の動向等に応じて、取得の申込みの受付を中止することがあります。

※申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

①解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日の前営業日

ニューヨークの銀行の休業日の前営業日

ロンドン証券取引所の休業日の前営業日

ロンドンの銀行の休業日の前営業日

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せん。

②解約単位

販売会社が定める単位

③解約価額

解約請求受付日の翌々営業日の基準価額

④信託財産留保額

ありません。

⑤解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑥解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑦支払開始日

解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して7営業日目から販売会社において支払います。

⑧解約請求受付時間

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。

ただし、2024 年 11 月 5 日以降は、以下の通りとなります。

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後 3 時 30 分までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。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。

⑨解約請求受付の中止および取消し

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（投資対象証券の換金の制限、投資対象国・地域における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）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。

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※換金（解約）手続等の詳細に関し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】

①基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上 1 万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

「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。

（資産の評価方法）

・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券

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、金融商品取引所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。

・転換社債／転換社債型新株予約権付社債

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、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（外国で取引されているものについては、原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、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。

・公社債等

原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）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。

残存期間 1 年以内の公社債等については、一部償却原価法による評価を適用することができます。

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・外貨建資産

原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円換算します。

- ・ 外国為替予約取引

原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。

- ・ 市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

②基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

③基準価額の照会方法

基準価額は、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アセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

(受付時間：営業日の 9:00～17:00)

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2027 年 2 月 5 日まで (2017 年 3 月 27 日設定)

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。また、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(4)【計算期間】

毎年 2 月 6 日から翌年 2 月 5 日まで

ただし、各計算期間終了日に該当する日 (以下「該当日」といいます。) が休業日の場合、各計算期間終了日は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。

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

①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、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。

②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。

③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（信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたとき、また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、書面決議の процедуруを行うことが困難な場合を除きます。）、信託約款の変更または併合（変更にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款変更等」といいます。）をしようとする場合には、書面による決議（「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに任意償還等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、受益者に対し書面をもって書面決議の通知を發します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、受益者が議決権を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、議決権を行使することができる受益者の議決権の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。

④反対受益者の受益権買取請求の不適用

委託会社がファンドの任意償還、重大な約款変更等を行う場合、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。この規定は、受益者が自己に帰属する受益権についてその全部または一部の償還を請求したときに、委託会社が信託約款の規定に基づいて信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じることとする場合には適用しません。

⑤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「投資信託受益権の取扱に関する契約」の契約期間は、契約締結日から1年とします。ただし双方から契約満了日の3ヵ月前までに別段の意思表示のないときは、さらに1年間延長するものとし、その後も同様とします。

⑥運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、交付運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更、ファンドの任意償還等があった場合は、その内容を交付運用報告書に記載します。

⑦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。

⑧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。

⑨信託事務の再信託

受託会社は、ファンドに係る信託事務の処理の一部について再信託受託会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、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。

⑩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。

<https://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】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

①分配金受取コース（一般コース）

収益分配金は、税金を差引いた後、毎計算期間の終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

②分配金再投資コース（累積投資コース）

収益分配金は、税金を差引いた後、「累積投資契約」に基づいて、決算日の基準価額により自動的に無手数料で全額再投資されます。

(2) 償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（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営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、償還金について支払開始日から10年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(3) 換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

くわしくは「第2 管理及び運営 2 換金（解約）手続等」を参照してください。

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、当期（2023 年 2 月 7 日から 2024 年 2 月 5 日まで）の財務諸表について、PwC Japan 有限責任監査法人により監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年4月10日

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan 有限責任監査法人

東京事務所
指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員

監査意見

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」に掲げられている海外債券セクション（ラップ向け）の2023年2月7日から2024年2月5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。

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、海外債券セクション（ラップ向け）の2024年2月5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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三菱UFJアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三菱UFJアセットマネジメント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) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

1 【財務諸表】

【海外債券セレクション（ラップ向け）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第 6 期 [2023 年 2 月 6 日現在]	第 7 期 [2024 年 2 月 5 日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	561,310,246	760,746,309
投資信託受益証券	6,806,800,802	8,024,921,607
親投資信託受益証券	13,621,822,472	17,221,867,710
流動資産合計	20,989,933,520	26,007,535,626
資産合計	20,989,933,520	26,007,535,626
負債の部		
流動負債		
未払解約金	19,913,370	74,040,402
未払受託者報酬	4,335,707	5,413,553
未払委託者報酬	36,853,422	46,015,148
未払利息	316	110
その他未払費用	390,151	487,161
流動負債合計	61,492,966	125,956,374
負債合計	61,492,966	125,956,374
純資産の部		
元本等		
元本	17,644,232,536	18,997,799,709
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,284,208,018	6,883,779,543
（分配準備積立金）	658,221,599	3,196,692,125
元本等合計	20,928,440,554	25,881,579,252
純資産合計	20,928,440,554	25,881,579,252
負債純資産合計	20,989,933,520	26,007,535,626

（2）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 6 期 自 2022 年 2 月 8 日 至 2023 年 2 月 6 日	第 7 期 自 2023 年 2 月 7 日 至 2024 年 2 月 5 日
営業収益		
受取利息	2,607	5,220
有価証券売買等損益	△29,850,109	3,342,621,043
営業収益合計	△29,847,502	3,342,626,263
営業費用		
支払利息	175,216	236,825
受託者報酬	7,752,372	10,211,757

委託者報酬	65,895,021	86,799,804
その他費用	697,586	918,936
営業費用合計	74,520,195	98,167,322
営業利益又は営業損失（△）	△104,367,697	3,244,458,941
経常利益又は経常損失（△）	△104,367,697	3,244,458,941
当期純利益又は当期純損失（△）	△104,367,697	3,244,458,941
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	28,619,080	315,305,347
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,191,088,390	3,284,208,018
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,757,246,408	1,509,699,358
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,757,246,408	1,509,699,358
剰余金減少額又は欠損金増加額	531,140,003	839,281,427
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	531,140,003	839,281,427
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,284,208,018	6,883,779,543

（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	投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。 ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年２月５日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は 2023 年 2 月 7 日から 2024 年 2 月 5 日までとなっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

	第 6 期 [2023 年 2 月 6 日現在]	第 7 期 [2024 年 2 月 5 日現在]
1. 期首元本額	11,810,435,273 円	17,644,232,536 円
期中追加設定元本額	8,626,815,259 円	5,688,995,068 円
期中一部解約元本額	2,793,017,996 円	4,335,427,895 円
2. 受益権の総数	17,644,232,536 口	18,997,799,709 口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第 6 期 自 2022 年 2 月 8 日 至 2023 年 2 月 6 日	第 7 期 自 2023 年 2 月 7 日 至 2024 年 2 月 5 日
1. 運用に係る権限を委託するための費用 該当事項はありません。	1. 運用に係る権限を委託するための費用 「海外債券マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年 10,000 分の 45 の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。
2. 分配金の計算過程	2. 分配金の計算過程
項目	項目

費用控除後の配当等収益額	A	186,093,149 円	費用控除後の配当等収益額	A	390,190,378 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	—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	2,287,250,784 円
収益調整金額	C	2,625,986,419 円	収益調整金額	C	3,687,087,418 円
分配準備積立金額	D	472,128,450 円	分配準備積立金額	D	519,250,963 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,284,208,018 円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,883,779,543 円
当ファンドの期末残存口数	F	17,644,232,536 口	当ファンドの期末残存口数	F	18,997,799,709 口
1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,861 円	1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,623 円
1 万口当たり分配金額	H	—円	1 万口当たり分配金額	H	—円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	—円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	—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 6 期 自 2022 年 2 月 8 日 至 2023 年 2 月 6 日	第 7 期 自 2023 年 2 月 7 日 至 2024 年 2 月 5 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、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。 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、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部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。	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部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、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第 6 期 [2023 年 2 月 6 日現在]	第 7 期 [2024 年 2 月 5 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	(1) 有価証券 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。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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
	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
 売買目的有価証券

種類	第 6 期 [2023 年 2 月 6 日現在]	第 7 期 [2024 年 2 月 5 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)
投資信託受益証券	16,304,381	1,241,594,914
親投資信託受益証券	△60,846,456	2,051,015,315
合計	△44,542,075	3,292,610,229

（デリバティブ取引に関する注記）
 取引の時価等に関する事項
 該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
 該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第 6 期 [2023 年 2 月 6 日現在]	第 7 期 [2024 年 2 月 5 日現在]
1口当たり純資産額	1.1861円	1.3623円
(1万口当たり純資産額)	(11,861円)	(13,623円)

（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
投資信託受益証券	グローバル社債ファンド T（適格機関投資家専用）	5,249,850,587	8,024,921,607	
投資信託受益証券 合計		5,249,850,587	8,024,921,607	
親投資信託受益証券	新興国債券インデックスマザーファンド	521,700,608	931,339,925	
	海外債券マザーファンド	421,263,769	1,237,251,689	

	外国債券インデックスマザーファンド	5,794,847,787	15,053,276,096	
親投資信託受益証券 合計		6,737,812,164	17,221,867,710	
合計		11,987,662,751	25,246,789,317	

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)

当ファンドの主要投資対象の状況は以下の通りです。
なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

外国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年2月5日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	3,538,190,820
コール・ローン	3,752,256,400
国債証券	532,600,509,911
派生商品評価勘定	125,226,114
未収入金	6,455,387,118
未収利息	4,092,444,358
前払費用	449,110,281
流動資産合計	551,013,125,002
資産合計	551,013,125,002
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	718,689
未払金	8,861,715,193
未払解約金	434,105,535
未払利息	543
流動負債合計	9,296,539,960
負債合計	9,296,539,960
純資産の部	
元本等	
元本	208,539,191,929
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	333,177,393,113

元本等合計	541,716,585,042
純資産合計	541,716,585,042
負債純資産合計	551,013,125,002

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年2月5日現在]
1. 期首	2023年2月7日
期首元本額	178,181,938,386円
期中追加設定元本額	55,828,290,037円
期中一部解約元本額	25,471,036,494円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）	280,161,201円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）	660,318,930円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）	424,607,535円
三菱UFJ 外国債券オープン	830,929,365円
三菱UFJ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	2,120,471,226円
三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	6,225,810,204円
三菱UFJ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	4,979,126,496円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	536,613,653円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）	96,293,479円
ファンド・マネジャー（海外債券）	905,409,715円
eMAXIS 先進国債券インデックス	6,109,701,947円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	2,356,179,203円
eMAXIS バランス（波乗り型）	209,001,844円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	1,025,575,071円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	422,343,755円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	241,606,005円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	162,527,239円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	39,941,484,364円
海外債券セレクション（ラップ向け）	5,794,847,787円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	11,739,951,284円
つみたて8資産均等バランス	5,812,124,886円
つみたて4資産均等バランス	2,108,350,857円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	4,732,395円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,667,823円

eMAXIS マイマネージャー 1990s	563,590 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	234,407,478 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	158,405,609 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	90,882,653 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	795,665,996 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	1,234,055,794 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	1,882,252,598 円
三菱UFJ DC年金インデックス (先進国債券)	2,072,023,811 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	77,363,735 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	176,431,406 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	35,898,921 円
ラップ向けインデックスf 先進国債券	2,775,594,348 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	33,631,295 円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	3,780,440,464 円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	76,839,332 円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	38,679,162 円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	49,544,258 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	205,783 円
三菱UFJ 外国債券オープン (確定拠出年金)	3,103,901,065 円
三菱UFJ 外国債券オープン (毎月分配型)	16,720,065,398 円
ワールド・インカムオープン	991,733,569 円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	15,659,296,095 円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (毎月分配型)	405,463,222 円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (年1回決算型)	2,171,738,633 円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	834,669,831 円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	517,127,644 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	283,849,061 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	519,418,168 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	210,606,510 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	72,520,383 円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA (適格機関投資家限定)	1,006,520,346 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)	106 円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2 (適格機関投資家限定)	10,381,599 円
MUAM 世界債券オープン (適格機関投資家限定)	1,028,398,736 円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	11,349,514 円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	1,521,503,629 円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	1,137,398,917 円
MUAM 外国債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)	41,659,915,340 円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	466,358,853 円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	386,002 円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	102,188 円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	1,254,985,117 円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	60,903,911 円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	106,218,802 円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家)	1,031,658,432 円

家転売制限付)	
世界8資産バランスファンドV L (適格機関投資家限定)	31,288,119 円
MUKAM 外国債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	2,482,416,530 円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)	655,362,166 円
外国債券インデックスファンドV (適格機関投資家限定)	778,442,758 円
海外債券インデックスファンドS	4,106,821,013 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) V A	1,615,289 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) V A	2,714,500 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) V A	503,873 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) V A	867,929 円
三菱UF J 外国債券インデックスファンドV A	4,358,448 円
三菱UF J バランスV A 3 0 D (適格機関投資家限定)	3,552,614 円
三菱UF J バランスV A 6 0 D (適格機関投資家限定)	7,461,109 円
三菱UF J バランスV A 3 0 G (適格機関投資家限定)	3,387,503 円
三菱UF J バランスV A 6 0 G (適格機関投資家限定)	8,643,518 円
三菱UF J <DC>外国債券インデックスファンド	1,764,379,574 円
三菱UF J <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)	193,602,286 円
三菱UF J <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)	555,216,211 円
三菱UF J <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)	458,750,389 円
三菱UF J <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型)	188,614,532 円
合計	208,539,191,929 円
2. 受益権の総数	208,539,191,929 口

※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 2023 年 2 月 7 日 至 2024 年 2 月 5 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、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。</p> <p>当ファンドは、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。</p> <p>また、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>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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、この結果はリスク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>

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年 2月 5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。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 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>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2024年 2月 5日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△2,460,883,312
合計	△2,460,883,312

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[2024年 2月 5日現在]

区分	種類	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				
	買建				
	アメリカドル	3,406,684,550	—	3,530,021,839	123,337,289
	カナダドル	25,291,330	—	25,367,731	76,401
	オーストラリアドル	17,363,700	—	17,375,502	11,802
	イギリスポンド	63,637,380	—	63,755,034	117,654
	シンガポールドル	5,530,900	—	5,530,725	△175
	デンマーククローネ	6,019,020	—	6,018,852	△168
	メキシコペソ	9,779,020	—	9,782,184	3,164
	イスラエルシェケル	30,184,350	—	30,479,925	295,575
	ポーランドズロチ	8,159,316	—	8,158,876	△440
	中国元	63,357,432	—	63,453,523	96,091
	ユーロ	433,031,640	—	434,254,138	1,222,498

	売建				
	マレーシアリンギット	33,361,308	—	33,655,824	△294,516
	メキシコペソ	22,590,985	—	22,948,735	△357,750
合計		4,124,990,931	—	4,250,802,888	124,507,425

（注）時価の算定方法

- 1 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。
- ①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。
- ②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。
- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
- ※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（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。

（１口当たり情報）	
	[2024 年 2 月 5 日現在]
1 口当たり純資産額	2.5977 円
(1 万口当たり純資産額)	(25,977 円)

附属明細表

第 1 有価証券明細表
(1)株式
該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
アメリカドル	国債証券	0.25 T-NOTE 250531	5,000,000.00	4,722,363.30	
		0.25 T-NOTE 250630	6,650,000.00	6,263,209.00	
		0.25 T-NOTE 250731	5,800,000.00	5,445,089.82	
		0.25 T-NOTE 250831	6,700,000.00	6,269,734.37	
		0.25 T-NOTE 250930	7,600,000.00	7,092,492.21	
		0.25 T-NOTE 251031	10,300,000.00	9,584,431.60	
		0.375 T-NOTE 250430	4,670,000.00	4,430,297.67	
		0.375 T-NOTE 251130	10,150,000.00	9,439,698.22	
		0.375 T-NOTE 251231	8,500,000.00	7,884,912.12	

0.375 T-NOTE 260131	9,200,000.00	8,507,125.00	
0.375 T-NOTE 270731	7,150,000.00	6,295,072.28	
0.375 T-NOTE 270930	7,300,000.00	6,393,773.47	
0.5 T-NOTE 250331	6,500,000.00	6,194,804.72	
0.5 T-NOTE 260228	9,900,000.00	9,155,566.43	
0.5 T-NOTE 270430	5,280,000.00	4,707,965.64	
0.5 T-NOTE 270531	5,490,000.00	4,881,810.93	
0.5 T-NOTE 270630	5,900,000.00	5,233,369.14	
0.5 T-NOTE 270831	4,950,000.00	4,367,214.81	
0.5 T-NOTE 271031	5,900,000.00	5,177,480.45	
0.625 T-NOTE 260731	7,930,000.00	7,263,539.24	
0.625 T-NOTE 270331	3,800,000.00	3,410,796.85	
0.625 T-NOTE 271130	7,550,000.00	6,642,377.95	
0.625 T-NOTE 271231	8,630,000.00	7,571,139.47	
0.625 T-NOTE 300515	12,090,000.00	9,833,514.90	
0.625 T-NOTE 300815	16,160,000.00	13,037,521.81	
0.75 T-NOTE 260331	8,100,000.00	7,517,496.11	
0.75 T-NOTE 260430	9,200,000.00	8,515,031.29	
0.75 T-NOTE 260531	8,200,000.00	7,570,105.43	
0.75 T-NOTE 260831	10,100,000.00	9,258,859.37	
0.75 T-NOTE 280131	9,950,000.00	8,752,113.32	
0.875 T-NOTE 260630	8,300,000.00	7,674,095.67	
0.875 T-NOTE 260930	10,000,000.00	9,182,031.20	
0.875 T-NOTE 301115	17,430,000.00	14,238,812.06	
1 T-NOTE 280731	9,150,000.00	8,024,121.04	
1.125 T-BOND 400515	6,020,000.00	3,804,592.98	
1.125 T-BOND 400815	7,550,000.00	4,724,206.08	
1.125 T-NOTE 250228	4,150,000.00	3,993,123.19	
1.125 T-NOTE 261031	10,450,000.00	9,633,593.75	
1.125 T-NOTE 270228	2,950,000.00	2,697,291.02	
1.125 T-NOTE 280229	9,760,000.00	8,701,268.77	
1.125 T-NOTE 280831	9,970,000.00	8,776,520.90	
1.125 T-NOTE 310215	16,920,000.00	14,026,746.14	
1.25 T-BOND 500515	9,420,000.00	4,898,400.00	
1.25 T-NOTE 261130	11,360,000.00	10,489,362.55	
1.25 T-NOTE 261231	8,200,000.00	7,559,855.43	

1. 25 T-NOTE 280331	9, 950, 000. 00	8, 897, 282. 23	
1. 25 T-NOTE 280430	9, 740, 000. 00	8, 691, 808. 56	
1. 25 T-NOTE 280531	9, 750, 000. 00	8, 683, 593. 75	
1. 25 T-NOTE 280630	9, 680, 000. 00	8, 604, 234. 39	
1. 25 T-NOTE 280930	10, 700, 000. 00	9, 452, 363. 30	
1. 25 T-NOTE 310815	17, 720, 000. 00	14, 572, 277. 32	
1. 375 T-BOND 401115	8, 400, 000. 00	5, 465, 250. 00	
1. 375 T-BOND 500815	10, 430, 000. 00	5, 605, 921. 29	
1. 375 T-NOTE 260831	3, 800, 000. 00	3, 539, 937. 50	
1. 375 T-NOTE 281031	8, 250, 000. 00	7, 318, 168. 93	
1. 375 T-NOTE 281231	8, 700, 000. 00	7, 691, 003. 92	
1. 375 T-NOTE 311115	16, 600, 000. 00	13, 697, 269. 54	
1. 5 T-NOTE 260815	9, 740, 000. 00	9, 108, 802. 31	
1. 5 T-NOTE 270131	9, 540, 000. 00	8, 838, 660. 98	
1. 5 T-NOTE 281130	9, 700, 000. 00	8, 641, 335. 97	
1. 5 T-NOTE 300215	8, 740, 000. 00	7, 574, 439. 01	
1. 625 T-BOND 501115	10, 710, 000. 00	6, 158, 877. 49	
1. 625 T-NOTE 260215	9, 760, 000. 00	9, 249, 887. 54	
1. 625 T-NOTE 260515	7, 670, 000. 00	7, 233, 469. 15	
1. 625 T-NOTE 260930	2, 100, 000. 00	1, 966, 617. 19	
1. 625 T-NOTE 261031	3, 350, 000. 00	3, 130, 941. 42	
1. 625 T-NOTE 261130	3, 400, 000. 00	3, 173, 554. 69	
1. 625 T-NOTE 290815	7, 050, 000. 00	6, 241, 728. 49	
1. 625 T-NOTE 310515	16, 640, 000. 00	14, 169, 675. 01	
1. 75 T-BOND 410815	11, 770, 000. 00	8, 043, 829. 49	
1. 75 T-NOTE 250315	9, 030, 000. 00	8, 738, 465. 00	
1. 75 T-NOTE 261231	4, 700, 000. 00	4, 395, 601. 58	
1. 75 T-NOTE 290131	8, 600, 000. 00	7, 730, 929. 66	
1. 75 T-NOTE 291115	5, 150, 000. 00	4, 574, 950. 17	
1. 875 T-BOND 410215	10, 700, 000. 00	7, 545, 380. 83	
1. 875 T-BOND 510215	11, 810, 000. 00	7, 240, 083. 64	
1. 875 T-BOND 511115	10, 930, 000. 00	6, 669, 861. 77	
1. 875 T-NOTE 260630	3, 500, 000. 00	3, 315, 771. 48	
1. 875 T-NOTE 260731	5, 500, 000. 00	5, 198, 574. 20	
1. 875 T-NOTE 270228	9, 120, 000. 00	8, 531, 118. 76	
1. 875 T-NOTE 290228	7, 800, 000. 00	7, 045, 593. 75	

1. 875 T-NOTE 320215	16, 860, 000. 00	14, 394, 883. 54	
2 T-BOND 411115	10, 220, 000. 00	7, 265, 581. 63	
2 T-BOND 500215	7, 790, 000. 00	4, 965, 820. 71	
2 T-BOND 510815	10, 790, 000. 00	6, 806, 129. 68	
2 T-NOTE 250815	11, 490, 000. 00	11, 067, 877. 16	
2 T-NOTE 261115	8, 680, 000. 00	8, 189, 376. 53	
2. 125 T-NOTE 250515	6, 970, 000. 00	6, 753, 276. 56	
2. 125 T-NOTE 260531	5, 000, 000. 00	4, 767, 089. 85	
2. 25 T-BOND 410515	8, 190, 000. 00	6, 122, 824. 82	
2. 25 T-BOND 460815	5, 040, 000. 00	3, 507, 328. 13	
2. 25 T-BOND 490815	6, 950, 000. 00	4, 714, 190. 41	
2. 25 T-BOND 520215	9, 890, 000. 00	6, 626, 106. 84	
2. 25 T-NOTE 251115	10, 290, 000. 00	9, 908, 546. 51	
2. 25 T-NOTE 260331	4, 500, 000. 00	4, 312, 617. 21	
2. 25 T-NOTE 270215	6, 810, 000. 00	6, 447, 819. 75	
2. 25 T-NOTE 270815	6, 190, 000. 00	5, 819, 688. 07	
2. 25 T-NOTE 271115	7, 500, 000. 00	7, 027, 294. 94	
2. 375 T-BOND 420215	7, 850, 000. 00	5, 918, 317. 36	
2. 375 T-BOND 491115	6, 910, 000. 00	4, 813, 786. 68	
2. 375 T-BOND 510515	11, 570, 000. 00	7, 995, 502. 76	
2. 375 T-NOTE 260430	4, 000, 000. 00	3, 839, 062. 48	
2. 375 T-NOTE 270515	9, 070, 000. 00	8, 590, 459. 21	
2. 375 T-NOTE 290331	7, 500, 000. 00	6, 934, 277. 32	
2. 375 T-NOTE 290515	7, 480, 000. 00	6, 906, 728. 16	
2. 5 T-BOND 450215	5, 050, 000. 00	3, 753, 767. 56	
2. 5 T-BOND 460215	4, 030, 000. 00	2, 963, 624. 19	
2. 5 T-BOND 460515	4, 210, 000. 00	3, 088, 758. 61	
2. 5 T-NOTE 260228	3, 450, 000. 00	3, 325, 476. 56	
2. 5 T-NOTE 270331	7, 700, 000. 00	7, 335, 453. 12	
2. 625 T-NOTE 250331	1, 960, 000. 00	1, 914, 062. 50	
2. 625 T-NOTE 250415	9, 000, 000. 00	8, 783, 085. 96	
2. 625 T-NOTE 251231	3, 200, 000. 00	3, 097, 750. 01	
2. 625 T-NOTE 260131	3, 900, 000. 00	3, 772, 792. 95	
2. 625 T-NOTE 270531	7, 900, 000. 00	7, 538, 636. 69	
2. 625 T-NOTE 290215	9, 640, 000. 00	9, 038, 629. 70	
2. 625 T-NOTE 290731	5, 600, 000. 00	5, 220, 250. 00	

2.75 T-BOND 420815	2,520,000.00	2,010,438.27	
2.75 T-BOND 421115	3,700,000.00	2,943,957.02	
2.75 T-BOND 470815	5,190,000.00	3,952,914.81	
2.75 T-BOND 471115	5,110,000.00	3,885,695.91	
2.75 T-NOTE 250515	6,400,000.00	6,250,875.00	
2.75 T-NOTE 250630	2,370,000.00	2,311,953.50	
2.75 T-NOTE 250831	4,050,000.00	3,942,738.26	
2.75 T-NOTE 270430	6,400,000.00	6,137,124.99	
2.75 T-NOTE 270731	7,650,000.00	7,317,852.52	
2.75 T-NOTE 280215	9,990,000.00	9,510,597.08	
2.75 T-NOTE 290531	7,160,000.00	6,730,959.33	
2.75 T-NOTE 320815	15,460,000.00	14,037,800.73	
2.875 T-BOND 430515	4,680,000.00	3,778,734.39	
2.875 T-BOND 450815	3,500,000.00	2,770,195.33	
2.875 T-BOND 461115	2,340,000.00	1,834,340.62	
2.875 T-BOND 490515	7,170,000.00	5,547,647.46	
2.875 T-BOND 520515	9,820,000.00	7,570,989.81	
2.875 T-NOTE 250430	6,000,000.00	5,869,921.86	
2.875 T-NOTE 250531	4,230,000.00	4,135,816.42	
2.875 T-NOTE 250615	7,800,000.00	7,624,652.33	
2.875 T-NOTE 250731	6,100,000.00	5,955,363.26	
2.875 T-NOTE 251130	3,800,000.00	3,696,984.35	
2.875 T-NOTE 280515	10,090,000.00	9,632,993.93	
2.875 T-NOTE 280815	10,310,000.00	9,822,489.99	
2.875 T-NOTE 290430	7,000,000.00	6,628,125.00	
2.875 T-NOTE 320515	15,480,000.00	14,231,320.35	
3 T-BOND 420515	2,270,000.00	1,888,400.57	
3 T-BOND 441115	3,900,000.00	3,173,244.12	
3 T-BOND 450515	2,790,000.00	2,260,826.36	
3 T-BOND 451115	2,000,000.00	1,615,625.00	
3 T-BOND 470215	3,630,000.00	2,905,488.86	
3 T-BOND 470515	3,390,000.00	2,708,292.18	
3 T-BOND 480215	5,970,000.00	4,751,397.09	
3 T-BOND 480815	7,070,000.00	5,614,159.93	
3 T-BOND 490215	6,600,000.00	5,233,078.09	
3 T-BOND 520815	8,670,000.00	6,864,878.94	

3 T-NOTE 250715	6, 700, 000. 00	6, 555, 400. 39	
3 T-NOTE 250930	5, 400, 000. 00	5, 273, 542. 96	
3 T-NOTE 251031	3, 300, 000. 00	3, 220, 078. 12	
3. 125 T-BOND 411115	1, 990, 000. 00	1, 697, 019. 14	
3. 125 T-BOND 420215	2, 200, 000. 00	1, 870, 300. 78	
3. 125 T-BOND 430215	3, 160, 000. 00	2, 658, 288. 27	
3. 125 T-BOND 440815	3, 940, 000. 00	3, 280, 203. 89	
3. 125 T-BOND 480515	6, 010, 000. 00	4, 890, 050. 56	
3. 125 T-NOTE 250815	5, 000, 000. 00	4, 897, 070. 30	
3. 125 T-NOTE 270831	7, 300, 000. 00	7, 067, 882. 77	
3. 125 T-NOTE 281115	8, 280, 000. 00	7, 964, 810. 12	
3. 125 T-NOTE 290831	5, 900, 000. 00	5, 639, 800. 79	
3. 25 T-BOND 420515	6, 950, 000. 00	5, 993, 017. 59	
3. 25 T-NOTE 270630	6, 300, 000. 00	6, 132, 164. 09	
3. 25 T-NOTE 290630	6, 170, 000. 00	5, 941, 999. 24	
3. 375 T-BOND 420815	6, 300, 000. 00	5, 525, 050. 79	
3. 375 T-BOND 440515	3, 380, 000. 00	2, 932, 017. 97	
3. 375 T-BOND 481115	6, 920, 000. 00	5, 882, 270. 29	
3. 375 T-NOTE 330515	16, 100, 000. 00	15, 292, 484. 37	
3. 5 T-BOND 390215	1, 360, 000. 00	1, 264, 693. 75	
3. 5 T-NOTE 250915	5, 100, 000. 00	5, 020, 611. 30	
3. 5 T-NOTE 280131	6, 100, 000. 00	5, 976, 212. 88	
3. 5 T-NOTE 280430	6, 900, 000. 00	6, 756, 339. 86	
3. 5 T-NOTE 300131	5, 800, 000. 00	5, 639, 480. 47	
3. 5 T-NOTE 300430	5, 600, 000. 00	5, 439, 218. 73	
3. 5 T-NOTE 330215	15, 100, 000. 00	14, 494, 820. 38	
3. 625 T-BOND 430815	3, 400, 000. 00	3, 074, 808. 59	
3. 625 T-BOND 440215	3, 870, 000. 00	3, 491, 087. 67	
3. 625 T-BOND 530215	8, 690, 000. 00	7, 784, 169. 34	
3. 625 T-BOND 530515	9, 060, 000. 00	8, 124, 979. 72	
3. 625 T-NOTE 260515	7, 000, 000. 00	6, 902, 929. 67	
3. 625 T-NOTE 280331	6, 000, 000. 00	5, 905, 546. 86	
3. 625 T-NOTE 280531	6, 600, 000. 00	6, 495, 070. 29	
3. 625 T-NOTE 300331	5, 500, 000. 00	5, 379, 902. 33	
3. 75 T-BOND 410815	2, 060, 000. 00	1, 923, 685. 92	
3. 75 T-BOND 431115	3, 360, 000. 00	3, 089, 100. 00	

3. 75 T-NOTE 260415	7,000,000.00	6,920,156.25	
3. 75 T-NOTE 281231	5,200,000.00	5,143,937.50	
3. 75 T-NOTE 300531	5,600,000.00	5,514,468.73	
3. 75 T-NOTE 300630	5,400,000.00	5,316,574.21	
3. 75 T-NOTE 301231	3,700,000.00	3,640,453.12	
3. 875 T-BOND 400815	1,870,000.00	1,789,429.29	
3. 875 T-BOND 430215	6,040,000.00	5,669,342.16	
3. 875 T-BOND 430515	6,200,000.00	5,814,437.50	
3. 875 T-NOTE 250331	5,000,000.00	4,952,050.80	
3. 875 T-NOTE 250430	4,000,000.00	3,961,171.88	
3. 875 T-NOTE 260115	6,700,000.00	6,637,841.82	
3. 875 T-NOTE 271130	6,900,000.00	6,852,832.01	
3. 875 T-NOTE 271231	7,000,000.00	6,953,242.17	
3. 875 T-NOTE 290930	6,030,000.00	5,984,303.92	
3. 875 T-NOTE 291130	5,100,000.00	5,061,949.20	
3. 875 T-NOTE 291231	5,700,000.00	5,655,802.71	
3. 875 T-NOTE 330815	16,640,000.00	16,444,999.97	
4 T-BOND 421115	5,870,000.00	5,616,856.25	
4 T-BOND 521115	9,230,000.00	8,847,820.30	
4 T-NOTE 251215	7,750,000.00	7,692,480.42	
4 T-NOTE 260215	8,000,000.00	7,947,187.52	
4 T-NOTE 270115	7,500,000.00	7,469,238.30	
4 T-NOTE 280229	6,020,000.00	6,008,242.21	
4 T-NOTE 280630	6,000,000.00	5,994,492.18	
4 T-NOTE 290131	7,400,000.00	7,403,757.79	
4 T-NOTE 291031	5,500,000.00	5,494,091.79	
4 T-NOTE 300228	6,270,000.00	6,262,162.50	
4 T-NOTE 300731	5,400,000.00	5,392,617.17	
4. 125 T-BOND 530815	10,020,000.00	9,830,559.35	
4. 125 T-NOTE 260615	7,000,000.00	6,979,355.46	
4. 125 T-NOTE 270930	7,440,000.00	7,451,770.29	
4. 125 T-NOTE 271031	6,500,000.00	6,509,140.62	
4. 125 T-NOTE 280731	7,700,000.00	7,733,236.35	
4. 125 T-NOTE 300831	6,500,000.00	6,535,800.75	
4. 125 T-NOTE 321115	16,070,000.00	16,179,853.55	
4. 25 T-BOND 390515	1,770,000.00	1,790,534.76	

4. 25 T-BOND 401115	1, 980, 000. 00	1, 980, 425. 37	
4. 25 T-NOTE 250531	9, 000, 000. 00	8, 955, 878. 94	
4. 25 T-NOTE 251015	6, 000, 000. 00	5, 977, 968. 72	
4. 25 T-NOTE 251231	2, 500, 000. 00	2, 493, 164. 05	
4. 25 T-NOTE 260131	4, 000, 000. 00	4, 003, 437. 50	
4. 375 T-BOND 380215	1, 000, 000. 00	1, 033, 242. 19	
4. 375 T-BOND 391115	2, 270, 000. 00	2, 320, 986. 32	
4. 375 T-BOND 400515	2, 080, 000. 00	2, 119, 243. 75	
4. 375 T-BOND 410515	1, 960, 000. 00	1, 984, 385. 16	
4. 375 T-BOND 430815	6, 920, 000. 00	6, 948, 112. 50	
4. 375 T-NOTE 260815	5, 500, 000. 00	5, 519, 765. 62	
4. 375 T-NOTE 261215	10, 000, 000. 00	10, 058, 593. 80	
4. 375 T-NOTE 280831	7, 000, 000. 00	7, 105, 000. 00	
4. 375 T-NOTE 281130	8, 050, 000. 00	8, 183, 956. 98	
4. 375 T-NOTE 301130	6, 250, 000. 00	6, 377, 929. 68	
4. 5 T-BOND 360215	1, 160, 000. 00	1, 222, 531. 25	
4. 5 T-BOND 380515	1, 330, 000. 00	1, 389, 200. 58	
4. 5 T-BOND 390815	1, 880, 000. 00	1, 952, 152. 35	
4. 5 T-NOTE 251115	4, 700, 000. 00	4, 704, 039. 08	
4. 5 T-NOTE 260715	6, 500, 000. 00	6, 539, 101. 53	
4. 5 T-NOTE 331115	15, 600, 000. 00	16, 191, 093. 64	
4. 625 T-BOND 400215	2, 100, 000. 00	2, 206, 271. 48	
4. 625 T-NOTE 250228	3, 000, 000. 00	2, 995, 232. 16	
4. 625 T-NOTE 250630	5, 000, 000. 00	5, 002, 734. 40	
4. 625 T-NOTE 260315	6, 000, 000. 00	6, 035, 273. 46	
4. 625 T-NOTE 260915	7, 500, 000. 00	7, 576, 025. 40	
4. 625 T-NOTE 261015	6, 800, 000. 00	6, 873, 976. 58	
4. 625 T-NOTE 261115	7, 000, 000. 00	7, 080, 937. 50	
4. 625 T-NOTE 280930	7, 050, 000. 00	7, 229, 554. 68	
4. 625 T-NOTE 300930	5, 700, 000. 00	5, 896, 828. 12	
4. 75 T-BOND 410215	2, 010, 000. 00	2, 132, 837. 69	
4. 75 T-BOND 431115	4, 980, 000. 00	5, 255, 845. 28	
4. 75 T-BOND 531115	9, 260, 000. 00	10, 085, 442. 09	
4. 75 T-NOTE 250731	7, 500, 000. 00	7, 521, 972. 67	
4. 875 T-NOTE 251130	8, 400, 000. 00	8, 464, 968. 79	
4. 875 T-NOTE 281031	8, 500, 000. 00	8, 813, 935. 51	

		4.875 T-NOTE 301031	6,100,000.00	6,402,140.62	
		5 T-BOND 370515	1,020,000.00	1,123,275.00	
		5 T-NOTE 250831	8,500,000.00	8,559,101.52	
		5 T-NOTE 250930	7,600,000.00	7,659,523.41	
		5 T-NOTE 251031	9,500,000.00	9,583,681.60	
		5.25 T-BOND 281115	2,690,000.00	2,833,011.32	
		5.375 T-BOND 310215	1,300,000.00	1,414,257.80	
		6 T-BOND 260215	1,200,000.00	1,239,140.62	
		6.125 T-BOND 271115	1,160,000.00	1,242,740.61	
		6.25 T-BOND 300515	1,150,000.00	1,290,830.08	
アメリカドル合計			1,872,320,000.00	1,695,762,984.22 (252,261,701,532)	
カナダドル	国債証券	0.25 CAN GOVT 260301	2,200,000.00	2,037,607.52	
		0.5 CAN GOVT 250901	2,900,000.00	2,735,702.47	
		0.5 CAN GOVT 301201	4,500,000.00	3,721,491.22	
		1 CAN GOVT 260901	2,500,000.00	2,327,978.52	
		1 CAN GOVT 270601	1,930,000.00	1,776,171.62	
		1.25 CAN GOVT 250301	2,100,000.00	2,028,027.75	
		1.25 CAN GOVT 270301	2,500,000.00	2,322,957.92	
		1.25 CAN GOVT 300601	4,410,000.00	3,878,690.16	
		1.5 CAN GOVT 250401	1,000,000.00	966,120.54	
		1.5 CAN GOVT 260601	4,070,000.00	3,854,319.05	
		1.5 CAN GOVT 310601	5,900,000.00	5,183,019.25	
		1.5 CAN GOVT 311201	4,270,000.00	3,719,240.24	
		1.75 CAN GOVT 531201	4,900,000.00	3,474,053.64	
		2 CAN GOVT 280601	2,670,000.00	2,515,919.55	
		2 CAN GOVT 320601	3,750,000.00	3,375,374.25	
		2 CAN GOVT 511201	6,060,000.00	4,620,007.83	
		2.25 CAN GOVT 250601	4,360,000.00	4,239,988.42	
		2.25 CAN GOVT 290601	2,210,000.00	2,091,088.89	
		2.25 CAN GOVT 291201	1,000,000.00	942,738.70	
		2.5 CAN GOVT 321201	3,500,000.00	3,265,719.20	
		2.75 CAN GOVT 270901	2,000,000.00	1,943,450.78	
		2.75 CAN GOVT 330601	3,000,000.00	2,850,435.81	
		2.75 CAN GOVT 481201	1,680,000.00	1,519,043.83	
		2.75 CAN GOVT 551201	1,750,000.00	1,566,958.77	

		2.75 CANADA GOVER 641201	1,250,000.00	1,110,353.17	
		3 CAN GOVT 251001	3,000,000.00	2,939,286.21	
		3 CAN GOVT 340601	1,200,000.00	1,159,806.46	
		3.25 CAN GOVT 280901	2,600,000.00	2,574,765.93	
		3.25 CAN GOVT 331201	3,170,000.00	3,135,669.88	
		3.5 CAN GOVT 280301	2,000,000.00	1,997,055.54	
		3.5 CAN GOVT 451201	1,650,000.00	1,689,004.87	
		3.75 CAN GOVT 250201	3,000,000.00	2,972,339.94	
		3.75 CAN GOVT 250501	3,500,000.00	3,469,118.52	
		4 CAN GOVT 290301	1,080,000.00	1,107,868.32	
		4 CAN GOVT 410601	1,200,000.00	1,298,861.54	
		4.5 CAN GOVT 251101	2,540,000.00	2,551,356.87	
		4.5 CAN GOVT 260201	700,000.00	705,772.90	
		5 CAN GOVT 370601	830,000.00	970,285.20	
		5.75 CAN GOVT 290601	950,000.00	1,058,221.54	
		5.75 CAN GOVT 330601	1,430,000.00	1,697,665.14	
カナダドル合計			105,260,000.00	97,393,537.96 (10,744,455,107)	
オーストラリアドル	国債証券	0.25 AUST GOVT 251121	5,450,000.00	5,130,834.26	
		0.5 AUST GOVT 260921	4,100,000.00	3,789,550.50	
		1 AUST GOVT 301221	3,010,000.00	2,506,339.71	
		1 AUST GOVT 311121	5,210,000.00	4,212,477.50	
		1.25 AUST GOVT 320521	4,530,000.00	3,684,193.41	
		1.5 AUST GOVT 310621	3,740,000.00	3,184,703.20	
		1.75 AUST GOVT 321121	3,980,000.00	3,336,347.19	
		1.75 AUST GOVT 510621	3,070,000.00	1,790,733.85	
		2.25 AUST GOVT 280521	2,900,000.00	2,749,103.69	
		2.5 AUST GOVT 300521	3,940,000.00	3,669,663.75	
		2.75 AUST GOVT 271121	2,490,000.00	2,420,092.10	
		2.75 AUST GOVT 281121	3,040,000.00	2,928,218.24	
		2.75 AUST GOVT 291121	2,980,000.00	2,836,167.26	
		2.75 AUST GOVT 350621	1,520,000.00	1,342,911.89	
		2.75 AUST GOVT 410521	2,170,000.00	1,764,860.82	
		3 AUST GOVT 331121	4,100,000.00	3,777,896.98	
		3 AUST GOVT 470321	2,020,000.00	1,618,207.33	
		3.25 AUST GOVT 250421	1,100,000.00	1,092,477.35	

		3. 25 AUST GOVT 290421	2, 660, 000. 00	2, 612, 356. 84	
		3. 25 AUST GOVT 390621	2, 130, 000. 00	1, 899, 624. 95	
		3. 5 AUST GOVT 341221	2, 300, 000. 00	2, 196, 068. 72	
		3. 75 AUST GOVT 340521	2, 300, 000. 00	2, 253, 440. 96	
		3. 75 AUST GOVT 370421	3, 150, 000. 00	3, 032, 686. 03	
		4. 25 AUST GOVT 260421	2, 490, 000. 00	2, 524, 554. 22	
		4. 5 AUST GOVT 330421	3, 900, 000. 00	4, 062, 761. 04	
		4. 75 AUST GOVT 270421	3, 050, 000. 00	3, 161, 345. 74	
		4. 75 AUST GOVT 540621	1, 270, 000. 00	1, 353, 398. 48	
オーストラリアドル合計			82, 600, 000. 00	74, 931, 016. 01 (7, 234, 589, 595)	
イギリス ポンド	国債証券	0. 125 GILT 260130	2, 600, 000. 00	2, 404, 090. 00	
		0. 125 GILT 280131	2, 300, 000. 00	1, 988, 233. 16	
		0. 25 GILT 250131	5, 100, 000. 00	4, 885, 771. 44	
		0. 25 GILT 310731	4, 460, 000. 00	3, 433, 731. 70	
		0. 375 GILT 261022	3, 750, 000. 00	3, 403, 800. 00	
		0. 375 GILT 301022	2, 390, 000. 00	1, 913, 601. 30	
		0. 5 GILT 290131	4, 900, 000. 00	4, 172, 742. 00	
		0. 5 GILT 611022	3, 700, 000. 00	1, 101, 490. 00	
		0. 625 GILT 250607	2, 880, 000. 00	2, 738, 942. 20	
		0. 625 GILT 350731	4, 030, 000. 00	2, 759, 744. 00	
		0. 625 GILT 501022	2, 890, 000. 00	1, 165, 826. 00	
		0. 875 GILT 291022	2, 320, 000. 00	1, 979, 303. 36	
		0. 875 GILT 330731	5, 140, 000. 00	3, 899, 461. 00	
		0. 875 GILT 460131	2, 980, 000. 00	1, 483, 146. 00	
		1 GILT 320131	5, 100, 000. 00	4, 108, 815. 00	
		1. 125 GILT 390131	3, 600, 000. 00	2, 334, 600. 00	
		1. 125 GILT 731022	1, 500, 000. 00	549, 600. 00	
		1. 25 GILT 270722	2, 100, 000. 00	1, 923, 159. 00	
		1. 25 GILT 411022	3, 750, 000. 00	2, 304, 000. 00	
		1. 25 GILT 510731	4, 180, 000. 00	2, 048, 910. 60	
		1. 5 GILT 260722	2, 490, 000. 00	2, 345, 829. 00	
		1. 5 GILT 470722	3, 160, 000. 00	1, 787, 599. 36	
		1. 5 GILT 530731	2, 950, 000. 00	1, 512, 081. 50	
		1. 625 GILT 281022	3, 470, 000. 00	3, 153, 189. 00	
		1. 625 GILT 541022	2, 470, 000. 00	1, 298, 362. 91	

	1. 625 GILT 711022	2, 530, 000. 00	1, 175, 185. 00	
	1. 75 GILT 370907	3, 340, 000. 00	2, 489, 302. 00	
	1. 75 GILT 490122	1, 780, 000. 00	1, 048, 028. 40	
	1. 75 GILT 570722	3, 230, 000. 00	1, 723, 528. 00	
	2 GILT 250907	2, 100, 000. 00	2, 023, 555. 80	
	2. 5 GILT 650722	2, 480, 000. 00	1, 584, 265. 66	
	3. 25 GILT 330131	5, 100, 000. 00	4, 848, 086. 52	
	3. 25 GILT 440122	3, 440, 000. 00	2, 875, 840. 00	
	3. 5 GILT 251022	6, 150, 000. 00	6, 059, 902. 50	
	3. 5 GILT 450122	3, 190, 000. 00	2, 754, 556. 06	
	3. 5 GILT 680722	2, 470, 000. 00	2, 039, 232. 00	
	3. 75 GILT 380129	3, 350, 000. 00	3, 166, 085. 00	
	3. 75 GILT 520722	2, 110, 000. 00	1, 849, 204. 00	
	3. 75 GILT 531022	4, 180, 000. 00	3, 643, 288. 00	
	4 GILT 600122	1, 980, 000. 00	1, 815, 569. 71	
	4 GILT 631022	1, 630, 000. 00	1, 488, 190. 00	
	4. 125 GILT 270129	4, 900, 000. 00	4, 913, 788. 60	
	4. 25 GILT 271207	2, 450, 000. 00	2, 480, 747. 50	
	4. 25 GILT 320607	3, 370, 000. 00	3, 471, 598. 76	
	4. 25 GILT 360307	3, 310, 000. 00	3, 352, 632. 80	
	4. 25 GILT 390907	2, 320, 000. 00	2, 293, 088. 00	
	4. 25 GILT 401207	2, 420, 000. 00	2, 378, 860. 00	
	4. 25 GILT 461207	2, 680, 000. 00	2, 574, 140. 00	
	4. 25 GILT 491207	1, 990, 000. 00	1, 902, 639. 00	
	4. 25 GILT 551207	2, 770, 000. 00	2, 645, 222. 58	
	4. 5 GILT 280607	2, 500, 000. 00	2, 559, 742. 00	
	4. 5 GILT 340907	1, 990, 000. 00	2, 070, 356. 20	
	4. 5 GILT 421207	3, 190, 000. 00	3, 209, 140. 00	
	4. 625 GILT 340131	1, 570, 000. 00	1, 651, 483. 00	
	4. 75 GILT 301207	3, 650, 000. 00	3, 861, 797. 82	
	4. 75 GILT 381207	2, 310, 000. 00	2, 424, 418. 92	
	4. 75 GILT 431022	1, 250, 000. 00	1, 292, 625. 00	
	5 GILT 250307	2, 490, 000. 00	2, 498, 160. 22	
	6 GILT 281207	1, 890, 000. 00	2, 072, 244. 19	
イギリスポンド合計		180, 320, 000. 00	148, 932, 531. 77 (27, 933, 785, 658)	

シンガポ ールドル	国債証券	1. 25 SINGAPORGOVT 261101	700, 000. 00	669, 620. 00	
		1. 625 SINGAPORGOV 310701	1, 050, 000. 00	963, 900. 00	
		1. 875 SINGAPORGOV 500301	700, 000. 00	574, 700. 00	
		1. 875 SINGAPORGOV 511001	950, 000. 00	788, 120. 00	
		2. 125 SINGAPORGOV 260601	1, 530, 000. 00	1, 500, 930. 00	
		2. 25 SINGAPORGOVT 360801	1, 300, 000. 00	1, 214, 590. 00	
		2. 375 SINGAPORGOV 250601	1, 560, 000. 00	1, 541, 592. 00	
		2. 375 SINGAPORGOV 390701	780, 000. 00	731, 265. 60	
		2. 625 SINGAPORGOV 280501	800, 000. 00	794, 160. 00	
		2. 625 SINGAPORGOV 320801	700, 000. 00	687, 750. 00	
		2. 75 SINGAPORGOVT 420401	980, 000. 00	962, 756. 90	
		2. 75 SINGAPORGOVT 460301	1, 140, 000. 00	1, 113, 210. 00	
		2. 875 SINGAPORGOV 270901	1, 000, 000. 00	1, 002, 000. 00	
		2. 875 SINGAPORGOV 280801	1, 000, 000. 00	1, 004, 400. 00	
		2. 875 SINGAPORGOV 290701	1, 760, 000. 00	1, 763, 344. 00	
		2. 875SINGAPORGOVT 300901	1, 340, 000. 00	1, 341, 340. 00	
		3 SINGAPORGOVT 720801	910, 000. 00	959, 595. 00	
		3. 375 SINGAPORGOV 330901	1, 280, 000. 00	1, 335, 916. 80	
		3. 5 SINGAPORGOVT 270301	1, 000, 000. 00	1, 018, 700. 00	
シンガポールドル合計			20, 480, 000. 00	19, 967, 890. 30 (2, 209, 247, 382)	
マレーシ アリンギ ット	国債証券	2. 632 MALAYSIAGOV 310415	2, 800, 000. 00	2, 613, 007. 23	
		3. 502MALAYSIAGOVT 270531	3, 000, 000. 00	3, 001, 951. 50	
		3. 582 MALAYSIAGOV 320715	2, 370, 000. 00	2, 329, 021. 53	
		3. 733 MALAYSIAGO 280615	2, 800, 000. 00	2, 818, 975. 32	
		3. 757 MALAYSIAGOV 400522	3, 980, 000. 00	3, 836, 878. 87	
		3. 828 MALAYSIAGOV 340705	3, 410, 000. 00	3, 419, 070. 60	
		3. 844 MALAYSIAGOV 330415	2, 400, 000. 00	2, 400, 241. 68	
		3. 882 MALAYSIAGOV 250314	1, 010, 000. 00	1, 016, 929. 50	
		3. 885 MALAYSIAGOV 290815	3, 600, 000. 00	3, 649, 835. 16	
		3. 892 MALAYSIAGOV 270315	5, 100, 000. 00	5, 159, 403. 27	
		3. 899 MALAYSIAGOV 271116	5, 640, 000. 00	5, 718, 114. 56	
		3. 9 MALAYSIAGOVT 261130	2, 470, 000. 00	2, 501, 470. 01	
		3. 906 MALAYSIAGOV 260715	2, 730, 000. 00	2, 763, 671. 82	
		3. 955 MALAYSIAGOV 250915	4, 270, 000. 00	4, 306, 455. 12	
		4. 065 MALAYSIAGOV 500615	5, 250, 000. 00	5, 158, 972. 82	

		4. 232MALAYSIAGOV 310630	2, 550, 000. 00	2, 635, 921. 74	
		4. 254 MALAYSIAGOV 350531	2, 150, 000. 00	2, 216, 202. 37	
		4. 392 MALAYSIAGOV 260415	1, 350, 000. 00	1, 376, 789. 40	
		4. 457 MALAYSIAGOV 530331	1, 600, 000. 00	1, 671, 431. 04	
		4. 498 MALAYSIAGOV 300415	3, 640, 000. 00	3, 799, 222. 33	
		4. 504 MALAYSIAGOV 290430	1, 500, 000. 00	1, 563, 492. 75	
		4. 642 MALAYSIAGOV 331107	2, 800, 000. 00	2, 995, 193. 60	
		4. 696 MALAYSIAGOV 421015	3, 900, 000. 00	4, 230, 531. 63	
		4. 736 MALAYSIAGOV 460315	1, 650, 000. 00	1, 786, 555. 48	
		4. 762 MALAYSIAGOV 370407	4, 440, 000. 00	4, 798, 803. 06	
		4. 893 MALAYSIAGOV 380608	3, 360, 000. 00	3, 702, 226. 41	
		4. 921 MALAYSIAGOV 480706	2, 020, 000. 00	2, 246, 367. 46	
		4. 935 MALAYSIAGOV 430930	1, 190, 000. 00	1, 319, 829. 83	
マレーシアリングット合計			82, 980, 000. 00	85, 036, 566. 09 (2, 657, 239, 624)	
ニュージー ランド ドル	国債証券	0. 25 NZ GOVT 280515	2, 000, 000. 00	1, 683, 760. 18	
		1. 75 NZ GOVT 410515	600, 000. 00	385, 519. 85	
		2 NZ GOVT 320515	2, 300, 000. 00	1, 908, 369. 11	
		2. 75 NZ GOVT 250415	1, 400, 000. 00	1, 362, 300. 49	
		2. 75 NZ GOVT 370415	1, 450, 000. 00	1, 172, 190. 93	
		2. 75 NZ GOVT 510515	1, 180, 000. 00	811, 263. 15	
		3 NZ GOVT 290420	1, 700, 000. 00	1, 595, 526. 05	
		3. 5 NZ GOVT 330414	1, 900, 000. 00	1, 755, 488. 03	
		4. 5 NZ GOVT 270415	1, 800, 000. 00	1, 803, 590. 46	
		4. 5 NZ GOVT 300515	1, 000, 000. 00	1, 006, 335. 20	
ニュージーランドドル合計			15, 330, 000. 00	13, 484, 343. 45 (1, 213, 995, 440)	
スウェー デンク ローネ	国債証券	0. 125 SWD GOVT 310512	9, 450, 000. 00	8, 180, 836. 65	
		0. 75 SWD GOVT 280512	8, 000, 000. 00	7, 532, 350. 40	
		0. 75 SWD GOVT 291112	12, 200, 000. 00	11, 302, 369. 87	
		1 SWD GOVT 261112	11, 960, 000. 00	11, 516, 710. 97	
		1. 75 SWD GOVT 331111	11, 500, 000. 00	11, 064, 337. 79	
		2. 25 SWD GOVT 320601	6, 750, 000. 00	6, 793, 044. 07	
		2. 5 SWD GOVT 250512	8, 840, 000. 00	8, 787, 695. 04	
		3. 5 SWD GOVT 390330	6, 470, 000. 00	7, 406, 856. 00	
スウェーデンクローネ合計			75, 170, 000. 00	72, 584, 200. 79	

				(1,025,614,757)	
ノルウェークローネ	国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	4,700,000.00	4,000,320.40	
		1.375 NORWE GOVT 300819	8,770,000.00	7,712,120.50	
		1.5 NORWE GOVT 260219	6,040,000.00	5,782,394.00	
		1.75 NORWE GOVT 250313	10,200,000.00	9,941,827.80	
		1.75 NORWE GOVT 270217	5,120,000.00	4,859,668.48	
		1.75 NORWE GOVT 290906	4,600,000.00	4,208,816.00	
		2 NORWE GOVT 280426	6,900,000.00	6,508,910.76	
		2.125 NORWE GOVT 320518	10,500,000.00	9,461,550.00	
		3 NORWE GOVT 330815	4,500,000.00	4,303,542.60	
		3.5 NORWE GOVT 421006	4,000,000.00	4,067,960.00	
ノルウェークローネ合計			65,330,000.00	60,847,110.54	
				(851,251,076)	
デンマーククロネ	国債証券	0 DMK GOVT 311115	14,550,000.00	12,190,837.82	
		0.25 DMK GOVT 521115	11,830,000.00	6,437,809.10	
		0.5 DMK GOVT 271115	8,100,000.00	7,570,281.06	
		0.5 DMK GOVT 291115	10,550,000.00	9,546,487.16	
		1.75 DMK GOVT 251115	7,490,000.00	7,373,043.65	
		2.25 DMK GOVT 331115	3,500,000.00	3,453,956.10	
		4.5 DMK GOVT 391115	15,650,000.00	19,630,173.73	
デンマーククロネ合計			71,670,000.00	66,202,588.62	
				(1,423,355,655)	
メキシコペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 361120	12,350,000.00	13,087,171.50	
		5 MEXICAN BONOS 250306	34,000,000.00	32,246,280.00	
		5.5 MEXICAN BONOS 270304	52,000,000.00	46,543,120.00	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	65,500,000.00	60,451,454.53	
		7 MEXICAN BONOS 260903	20,000,000.00	18,766,200.00	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	48,750,000.00	46,221,825.00	
		7.5 MEXICAN BONOS 330526	34,000,000.00	30,398,380.00	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	68,050,000.00	62,953,735.50	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	13,400,000.00	12,075,678.00	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	49,690,000.00	42,813,897.80	
		8 MEXICAN BONOS 350524	5,000,000.00	4,552,900.00	
		8 MEXICAN BONOS 471107	39,100,000.00	34,250,818.00	
		8 MEXICAN BONOS 530731	33,270,000.00	28,906,639.50	
		8.5 MEXICAN BONOS 290301	13,420,000.00	13,023,170.60	

		8. 5 MEXICAN BONOS 290531	39, 150, 000. 00	38, 092, 167. 00	
		8. 5 MEXICAN BONOS 381118	39, 700, 000. 00	37, 252, 098. 00	
メキシコペソ合計			567, 380, 000. 00	521, 635, 535. 43 (4, 518, 928, 643)	
イスラエル シェケル	国債証券	0. 5 ISRAEL FIXED 250430	6, 500, 000. 00	6, 266, 975. 00	
		0. 5 ISRAEL FIXED 260227	5, 800, 000. 00	5, 491, 440. 00	
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	3, 370, 000. 00	2, 865, 342. 50	
		1. 3 ISRAEL FIXED 320430	4, 800, 000. 00	3, 916, 560. 00	
		1. 5 ISRAEL FIXED 370531	4, 900, 000. 00	3, 506, 440. 00	
		2. 25 ISRAEL FIXED 280928	3, 080, 000. 00	2, 920, 456. 00	
		2. 8 ISRAEL FIXED 521129	800, 000. 00	561, 360. 00	
		3. 75 ISRAEL FIXED 290228	4, 600, 000. 00	4, 746, 280. 00	
		3. 75 ISRAEL FIXED 470331	4, 680, 000. 00	4, 222, 062. 00	
		5. 5 ISRAEL FIXED 420131	3, 130, 000. 00	3, 485, 098. 50	
6. 25 ISRAEL FIXED 261030	5, 000, 000. 00	5, 409, 000. 00			
イスラエルシェケル合計			46, 660, 000. 00	43, 391, 014. 00 (1, 763, 627, 764)	
ポーランド ズロチ	国債証券	0. 25 POLAND 261025	3, 000, 000. 00	2, 651, 883. 00	
		0. 75 POLAND 250425	3, 500, 000. 00	3, 329, 868. 50	
		1. 25 POLAND 301025	9, 190, 000. 00	7, 253, 492. 39	
		1. 75 POLAND 320425	9, 900, 000. 00	7, 690, 052. 70	
		2. 5 POLAND 260725	7, 840, 000. 00	7, 405, 491. 52	
		2. 5 POLAND 270725	6, 110, 000. 00	5, 643, 257. 10	
		2. 75 POLAND 280425	5, 760, 000. 00	5, 288, 002. 56	
		2. 75 POLAND 291025	7, 900, 000. 00	7, 038, 663. 00	
		3. 25 POLAND 250725	8, 700, 000. 00	8, 485, 762. 50	
		3. 75 POLAND 270525	4, 000, 000. 00	3, 857, 364. 00	
		5. 75 POLAND 290425	5, 600, 000. 00	5, 771, 488. 80	
		6 POLAND 331025	2, 000, 000. 00	2, 112, 277. 20	
		7. 5 POLAND 280725	6, 000, 000. 00	6, 581, 770. 80	
ポーランドズロチ合計			79, 500, 000. 00	73, 109, 374. 07 (2, 712, 270, 046)	
中国元	国債証券	1. 99 CHINA GOVT 250409	35, 000, 000. 00	34, 982, 344. 60	
		2 CHINA GOVT 250615	42, 000, 000. 00	41, 923, 589. 82	
		2. 18 CHINA GOVT 250825	34, 000, 000. 00	34, 027, 961. 60	
		2. 18 CHINA GOVT 260815	35, 000, 000. 00	34, 995, 050. 30	

2. 22 CHINA GOVT 250925	50,000,000.00	50,077,595.00	
2. 24 CHINA GOVT 250525	18,000,000.00	18,038,646.00	
2. 26 CHINA GOVT 250224	14,000,000.00	14,041,624.80	
2. 28 CHINA GOVT 251125	34,000,000.00	34,060,928.00	
2. 3 CHINA GOVT 260515	30,000,000.00	30,073,650.00	
2. 33 CHINA GOVT 251215	30,000,000.00	30,103,305.00	
2. 35 CHINA GOVT 250315	22,000,000.00	22,083,430.60	
2. 37 CHINA GOVT 270120	28,000,000.00	28,131,796.00	
2. 37 CHINA GOVT 290115	20,000,000.00	20,069,184.00	
2. 39 CHINA GOVT 261115	25,000,000.00	25,133,692.50	
2. 4 CHINA GOVT 280715	31,000,000.00	31,062,530.10	
2. 44 CHINA GOVT 271015	23,000,000.00	23,118,645.50	
2. 46 CHINA GOVT 260215	29,000,000.00	29,166,613.70	
2. 48 CHINA GOVT 270415	28,000,000.00	28,152,684.00	
2. 48 CHINA GOVT 280925	12,000,000.00	12,090,930.00	
2. 5 CHINA GOVT 270725	25,000,000.00	25,170,267.50	
2. 52 CHINA GOVT 330825	37,000,000.00	37,202,822.90	
2. 54 CHINA GOVT 301225	25,000,000.00	25,167,805.00	
2. 55 CHINA GOVT 281015	50,000,000.00	50,530,300.00	
2. 6 CHINA GOVT 300915	39,000,000.00	39,427,053.90	
2. 6 CHINA GOVT 320901	25,000,000.00	25,195,980.00	
2. 62 CHINA GOVT 280415	33,000,000.00	33,449,182.80	
2. 62 CHINA GOVT 290925	23,000,000.00	23,278,442.60	
2. 62 CHINA GOVT 300625	31,000,000.00	31,339,295.00	
2. 64 CHINA GOVT 280115	41,000,000.00	41,536,091.40	
2. 67 CHINA GOVT 330525	28,000,000.00	28,444,684.80	
2. 67 CHINA GOVT 331125	43,000,000.00	43,915,117.40	
2. 68 CHINA GOVT 300521	45,000,000.00	45,653,715.00	
2. 69 CHINA GOVT 260812	34,000,000.00	34,400,720.60	
2. 69 CHINA GOVT 320815	26,000,000.00	26,408,298.80	
2. 74 CHINA GOVT 260804	15,000,000.00	15,218,385.00	
2. 75 CHINA GOVT 290615	30,000,000.00	30,567,192.00	
2. 75 CHINA GOVT 320217	30,000,000.00	30,595,251.00	
2. 76 CHINA GOVT 320515	25,000,000.00	25,529,197.50	
2. 79 CHINA GOVT 291215	31,000,000.00	31,649,521.30	
2. 8 CHINA GOVT 290324	27,000,000.00	27,606,317.40	

2. 8 CHINA GOVT 300325	35, 000, 000. 00	35, 721, 945. 00	
2. 8 CHINA GOVT 321115	29, 000, 000. 00	29, 702, 725. 10	
2. 85 CHINA GOVT 270604	32, 000, 000. 00	32, 618, 528. 00	
2. 88 CHINA GOVT 330225	26, 000, 000. 00	26, 833, 261. 00	
2. 89 CHINA GOVT 311118	20, 000, 000. 00	20, 595, 522. 00	
2. 9 CHINA GOVT 260505	24, 000, 000. 00	24, 398, 013. 60	
2. 91 CHINA GOVT 281014	32, 000, 000. 00	32, 845, 350. 40	
2. 99 CHINA GOVT 251015	39, 000, 000. 00	39, 626, 488. 20	
3 CHINA GOVT 531015	13, 000, 000. 00	13, 989, 705. 60	
3. 01 CHINA GOVT 280513	39, 000, 000. 00	40, 188, 907. 20	
3. 02 CHINA GOVT 251022	36, 000, 000. 00	36, 576, 756. 00	
3. 02 CHINA GOVT 310527	38, 000, 000. 00	39, 440, 724. 40	
3. 03 CHINA GOVT 260311	28, 000, 000. 00	28, 541, 856. 00	
3. 12 CHINA GOVT 261205	37, 000, 000. 00	37, 995, 910. 50	
3. 12 CHINA GOVT 521025	15, 000, 000. 00	16, 263, 163. 50	
3. 13 CHINA GOVT 291121	30, 000, 000. 00	31, 243, 443. 00	
3. 19 CHINA GOVT 530415	17, 000, 000. 00	18, 855, 833. 90	
3. 22 CHINA GOVT 251206	18, 000, 000. 00	18, 387, 635. 40	
3. 25 CHINA GOVT 260606	28, 000, 000. 00	28, 747, 742. 80	
3. 25 CHINA GOVT 281122	17, 000, 000. 00	17, 784, 980. 10	
3. 27 CHINA GOVT 301119	35, 000, 000. 00	36, 939, 728. 00	
3. 28 CHINA GOVT 271203	24, 000, 000. 00	24, 989, 978. 40	
3. 29 CHINA GOVT 290523	29, 000, 000. 00	30, 417, 624. 40	
3. 32 CHINA GOVT 520415	17, 000, 000. 00	19, 097, 798. 30	
3. 39 CHINA GOVT 500316	32, 000, 000. 00	36, 141, 516. 80	
3. 52 CHINA GOVT 270504	19, 000, 000. 00	19, 888, 466. 60	
3. 53 CHINA GOVT 511018	16, 000, 000. 00	18, 584, 275. 20	
3. 54 CHINA GOVT 280816	13, 000, 000. 00	13, 774, 681. 70	
3. 59 CHINA GOVT 270803	7, 000, 000. 00	7, 361, 143. 30	
3. 6 CHINA GOVT 250906	8, 000, 000. 00	8, 217, 760. 80	
3. 61 CHINA GOVT 250607	10, 000, 000. 00	10, 240, 669. 00	
3. 69 CHINA GOVT 280517	15, 000, 000. 00	15, 996, 141. 00	
3. 72 CHINA GOVT 510412	21, 000, 000. 00	25, 104, 355. 50	
3. 77 CHINA GOVT 250308	11, 000, 000. 00	11, 243, 082. 40	
3. 81 CHINA GOVT 500914	33, 000, 000. 00	39, 920, 641. 20	
3. 86 CHINA GOVT 490722	25, 000, 000. 00	30, 284, 410. 00	

		4. 08 CHINA GOVT 481022	25, 000, 000. 00	31, 243, 907. 50	
中国元合計			2, 096, 000, 000. 00	2, 163, 424, 515. 22 (44, 721, 013, 523)	
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 250420	800, 000. 00	771, 798. 40	
		0 AUSTRIA GOVT 281020	1, 790, 000. 00	1, 592, 101. 18	
		0 AUSTRIA GOVT 300220	2, 150, 000. 00	1, 847, 836. 85	
		0 AUSTRIA GOVT 310220	2, 130, 000. 00	1, 776, 451. 95	
		0 AUSTRIA GOVT 401020	810, 000. 00	494, 427. 24	
		0 BEL GOVT 271022	1, 800, 000. 00	1, 643, 056. 20	
		0 BEL GOVT 311022	2, 300, 000. 00	1, 880, 574. 87	
		0 BUND 260815	5, 930, 000. 00	5, 587, 933. 88	
		0 BUND 271115	3, 100, 000. 00	2, 855, 360. 40	
		0 BUND 281115	4, 400, 000. 00	3, 978, 268. 80	
		0 BUND 290815	4, 550, 000. 00	4, 053, 613. 20	
		0 BUND 300215	4, 820, 000. 00	4, 248, 911. 94	
		0 BUND 300815	4, 960, 000. 00	4, 328, 492. 80	
		0 BUND 300815	1, 550, 000. 00	1, 354, 151. 30	
		0 BUND 310215	3, 700, 000. 00	3, 193, 692. 00	
		0 BUND 310815	5, 400, 000. 00	4, 611, 789. 00	
		0 BUND 310815	1, 900, 000. 00	1, 623, 392. 30	
		0 BUND 320215	4, 690, 000. 00	3, 957, 243. 78	
		0 BUND 350515	3, 630, 000. 00	2, 808, 701. 61	
		0 BUND 360515	3, 800, 000. 00	2, 858, 983. 20	
		0 BUND 500815	6, 220, 000. 00	3, 306, 707. 50	
		0 BUND 500815	1, 560, 000. 00	833, 074. 32	
		0 BUND 520815	4, 540, 000. 00	2, 302, 243. 08	
		0 FINNISH GOVT 300915	750, 000. 00	633, 519. 15	
		0 IRISH GOVT 311018	1, 350, 000. 00	1, 119, 423. 24	
		0 ITALY GOVT 260401	3, 300, 000. 00	3, 094, 056. 90	
		0 ITALY GOVT 260801	5, 000, 000. 00	4, 644, 389. 50	
		0 NETH GOVT 260115	2, 200, 000. 00	2, 091, 161. 60	
		0 NETH GOVT 270115	1, 950, 000. 00	1, 817, 259. 60	
		0 NETH GOVT 290115	1, 300, 000. 00	1, 158, 116. 83	
		0 NETH GOVT 300715	2, 650, 000. 00	2, 276, 334. 89	
		0 NETH GOVT 310715	2, 220, 000. 00	1, 859, 520. 54	
		0 NETH GOVT 380115	1, 540, 000. 00	1, 060, 870. 58	

0 NETH GOVT 520115	2, 830, 000. 00	1, 389, 903. 56	
0 O. A. T 250225	1, 000, 000. 00	967, 609. 00	
0 O. A. T 250325	7, 380, 000. 00	7, 127, 899. 20	
0 O. A. T 260225	6, 600, 000. 00	6, 255, 909. 00	
0 O. A. T 270225	6, 130, 000. 00	5, 682, 479. 35	
0 O. A. T 291125	7, 180, 000. 00	6, 226, 744. 42	
0 O. A. T 301125	8, 840, 000. 00	7, 456, 274. 80	
0 O. A. T 311125	8, 400, 000. 00	6, 884, 228. 40	
0 O. A. T 320525	6, 530, 000. 00	5, 268, 332. 17	
0 OBL 250411	2, 800, 000. 00	2, 703, 094. 80	
0 OBL 251010	4, 000, 000. 00	3, 825, 933. 32	
0 OBL 251010	1, 000, 000. 00	958, 159. 60	
0 OBL 260410	6, 910, 000. 00	6, 551, 927. 25	
0 OBL 261009	2, 900, 000. 00	2, 724, 344. 10	
0 OBL 270416	3, 050, 000. 00	2, 838, 891. 20	
0 SPAIN GOVT 250131	3, 630, 000. 00	3, 514, 270. 15	
0 SPAIN GOVT 250531	2, 500, 000. 00	2, 401, 232. 67	
0 SPAIN GOVT 260131	3, 000, 000. 00	2, 836, 893. 00	
0 SPAIN GOVT 270131	3, 800, 000. 00	3, 504, 249. 80	
0 SPAIN GOVT 280131	3, 800, 000. 00	3, 412, 122. 60	
0. 1 BEL GOVT 300622	2, 500, 000. 00	2, 144, 123. 74	
0. 1 SPAIN GOVT 310430	4, 360, 000. 00	3, 565, 499. 00	
0. 125 FINNISH GOV 310915	1, 070, 000. 00	887, 123. 09	
0. 125 FINNISH GOV 360415	510, 000. 00	365, 750. 98	
0. 125 FINNISH GOV 520415	750, 000. 00	353, 378. 25	
0. 2 IRISH GOVT 270515	500, 000. 00	465, 832. 50	
0. 2 IRISH GOVT 301018	1, 220, 000. 00	1, 053, 751. 62	
0. 25 AUSTRIA GOVT 361020	1, 050, 000. 00	754, 506. 90	
0. 25 BUND 270215	4, 490, 000. 00	4, 226, 104. 74	
0. 25 BUND 280815	4, 170, 000. 00	3, 833, 564. 40	
0. 25 BUND 290215	4, 850, 000. 00	4, 421, 808. 05	
0. 25 FINNISH GOVT 400915	540, 000. 00	347, 496. 48	
0. 25 ITALY GOVT 280315	2, 700, 000. 00	2, 408, 262. 30	
0. 25 NETH GOVT 250715	1, 930, 000. 00	1, 859, 685. 46	
0. 25 NETH GOVT 290715	2, 950, 000. 00	2, 635, 937. 10	
0. 25 O. A. T 261125	7, 360, 000. 00	6, 910, 591. 04	

0. 35 BEL GOVT 320622	2, 940, 000. 00	2, 426, 529. 00	
0. 35 IRISH GOVT 321018	800, 000. 00	666, 290. 40	
0. 35 ITALY GOVT 250201	1, 060, 000. 00	1, 029, 419. 00	
0. 4 BEL GOVT 400622	1, 300, 000. 00	845, 417. 30	
0. 4 IRISH GOVT 350515	1, 020, 000. 00	796, 960. 68	
0. 45 ITALY GOVT 290215	2, 300, 000. 00	2, 010, 687. 60	
0. 5 AUSTRIA GOVT 270420	2, 100, 000. 00	1, 971, 690. 00	
0. 5 AUSTRIA GOVT 290220	2, 050, 000. 00	1, 856, 008. 50	
0. 5 BUND 250215	7, 110, 000. 00	6, 921, 598. 08	
0. 5 BUND 260215	6, 660, 000. 00	6, 394, 805. 46	
0. 5 BUND 270815	5, 120, 000. 00	4, 826, 286. 08	
0. 5 BUND 280215	4, 280, 000. 00	4, 007, 685. 00	
0. 5 FINNISH GOVT 260415	1, 670, 000. 00	1, 595, 666. 21	
0. 5 FINNISH GOVT 270915	700, 000. 00	652, 245. 30	
0. 5 FINNISH GOVT 280915	1, 480, 000. 00	1, 352, 053. 55	
0. 5 FINNISH GOVT 290915	1, 350, 000. 00	1, 208, 108. 25	
0. 5 FINNISH GOVT 430415	780, 000. 00	495, 707. 16	
0. 5 ITALY GOVT 260201	2, 450, 000. 00	2, 330, 281. 46	
0. 5 ITALY GOVT 280715	2, 400, 000. 00	2, 143, 334. 40	
0. 5 NETH GOVT 260715	3, 970, 000. 00	3, 782, 370. 25	
0. 5 NETH GOVT 320715	2, 300, 000. 00	1, 959, 302. 08	
0. 5 NETH GOVT 400115	2, 630, 000. 00	1, 891, 364. 50	
0. 5 O. A. T 250525	6, 490, 000. 00	6, 286, 778. 63	
0. 5 O. A. T 260525	7, 530, 000. 00	7, 180, 171. 26	
0. 5 O. A. T 290525	9, 030, 000. 00	8, 150, 523. 15	
0. 5 O. A. T 400525	3, 990, 000. 00	2, 679, 480. 51	
0. 5 O. A. T 440625	3, 390, 000. 00	2, 053, 773. 87	
0. 5 O. A. T 720525	2, 100, 000. 00	821, 156. 70	
0. 5 SPAIN GOVT 300430	3, 580, 000. 00	3, 105, 536. 15	
0. 5 SPAIN GOVT 311031	3, 190, 000. 00	2, 651, 263. 23	
0. 55 IRISH GOVT 410422	600, 000. 00	410, 470. 80	
0. 6 ITALY GOVT 310801	3, 100, 000. 00	2, 517, 652. 16	
0. 6 SPAIN GOVT 291031	3, 680, 000. 00	3, 252, 299. 36	
0. 65 BEL GOVT 710622	1, 090, 000. 00	459, 375. 05	
0. 7 AUSTRIA GOVT 710420	680, 000. 00	310, 041. 92	
0. 7 SPAIN GOVT 320430	3, 800, 000. 00	3, 166, 160. 00	

0. 75 AUSTRIA GOVT 261020	2, 480, 000. 00	2, 363, 335. 84	
0. 75 AUSTRIA GOVT 280220	1, 690, 000. 00	1, 578, 437. 60	
0. 75 AUSTRIA GOVT 510320	1, 570, 000. 00	921, 043. 64	
0. 75 FINNISH GOVT 310415	1, 050, 000. 00	923, 490. 75	
0. 75 NETH GOVT 270715	2, 670, 000. 00	2, 527, 648. 95	
0. 75 NETH GOVT 280715	3, 020, 000. 00	2, 816, 470. 12	
0. 75 O. A. T 280225	7, 400, 000. 00	6, 911, 359. 50	
0. 75 O. A. T 280525	9, 750, 000. 00	9, 072, 345. 75	
0. 75 O. A. T 281125	9, 060, 000. 00	8, 361, 990. 42	
0. 75 O. A. T 520525	5, 560, 000. 00	3, 043, 577. 36	
0. 75 O. A. T 530525	4, 990, 000. 00	2, 671, 850. 59	
0. 8 BEL GOVT 250622	2, 970, 000. 00	2, 884, 553. 10	
0. 8 BEL GOVT 270622	2, 880, 000. 00	2, 723, 564. 16	
0. 8 BEL GOVT 280622	2, 250, 000. 00	2, 097, 083. 25	
0. 8 SPAIN GOVT 270730	3, 350, 000. 00	3, 136, 417. 40	
0. 8 SPAIN GOVT 290730	5, 430, 000. 00	4, 879, 477. 86	
0. 85 AUSTRIA GOVT 200630	650, 000. 00	293, 250. 75	
0. 85 ITALY GOVT 270115	3, 060, 000. 00	2, 878, 159. 50	
0. 85 SPAIN GOVT 370730	2, 470, 000. 00	1, 783, 461. 03	
0. 875 FINNISH GOV 250915	630, 000. 00	611, 272. 62	
0. 9 AUSTRIA GOVT 320220	2, 120, 000. 00	1, 848, 735. 40	
0. 9 BEL GOVT 290622	3, 090, 000. 00	2, 846, 322. 60	
0. 9 IRISH GOVT 280515	1, 640, 000. 00	1, 544, 321. 58	
0. 9 ITALY GOVT 310401	4, 230, 000. 00	3, 554, 898. 34	
0. 95 ITALY GOVT 270915	4, 000, 000. 00	3, 719, 376. 00	
0. 95 ITALY GOVT 300801	2, 940, 000. 00	2, 527, 506. 24	
0. 95 ITALY GOVT 311201	2, 730, 000. 00	2, 256, 142. 98	
0. 95 ITALY GOVT 320601	3, 600, 000. 00	2, 930, 155. 20	
0. 95 ITALY GOVT 370301	2, 560, 000. 00	1, 776, 389. 12	
1 BEL GOVT 260622	2, 760, 000. 00	2, 659, 392. 48	
1 BEL GOVT 310622	2, 850, 000. 00	2, 542, 180. 05	
1 BUND 250815	5, 580, 000. 00	5, 431, 740. 34	
1 BUND 380515	3, 610, 000. 00	2, 998, 350. 48	
1 IRISH GOVT 260515	1, 850, 000. 00	1, 788, 363. 55	
1 O. A. T 251125	6, 580, 000. 00	6, 379, 928. 52	
1 O. A. T 270525	6, 260, 000. 00	5, 966, 262. 02	

1 SPAIN GOVT 420730	2, 070, 000. 00	1, 342, 550. 25	
1 SPAIN GOVT 501031	3, 650, 000. 00	1, 975, 734. 05	
1. 1 IRISH GOVT 290515	1, 610, 000. 00	1, 507, 633. 62	
1. 1 ITALY GOVT 270401	3, 300, 000. 00	3, 113, 533. 50	
1. 125 FINNISH GOV 340415	730, 000. 00	623, 547. 75	
1. 2 AUSTRIA GOVT 251020	2, 710, 000. 00	2, 640, 226. 98	
1. 2 ITALY GOVT 250815	2, 100, 000. 00	2, 039, 538. 90	
1. 2 SPAIN GOVT 401031	3, 030, 000. 00	2, 121, 409. 05	
1. 25 BEL GOVT 330422	1, 770, 000. 00	1, 564, 042. 80	
1. 25 BUND 480815	5, 990, 000. 00	4, 689, 433. 23	
1. 25 ITALY GOVT 261201	2, 680, 000. 00	2, 556, 165. 69	
1. 25 O. A. T 340525	6, 490, 000. 00	5, 611, 922. 47	
1. 25 O. A. T 360525	7, 150, 000. 00	5, 934, 414. 20	
1. 25 O. A. T 380525	2, 880, 000. 00	2, 291, 869. 44	
1. 25 SPAIN GOVT 301031	4, 030, 000. 00	3, 627, 689. 13	
1. 3 IRISH GOVT 330515	860, 000. 00	771, 709. 82	
1. 3 OBL 271015	5, 750, 000. 00	5, 565, 885. 00	
1. 3 OBL 271015	800, 000. 00	775, 564. 93	
1. 3 SPAIN GOVT 261031	4, 750, 000. 00	4, 571, 843. 78	
1. 35 IRISH GOVT 310318	1, 070, 000. 00	995, 294. 74	
1. 35 ITALY GOVT 300401	3, 610, 000. 00	3, 215, 394. 51	
1. 375 FINNISH GOV 270415	800, 000. 00	772, 141. 60	
1. 375 FINNISH GOV 470415	840, 000. 00	617, 426. 04	
1. 4 BEL GOVT 530622	1, 720, 000. 00	1, 107, 067. 68	
1. 4 SPAIN GOVT 280430	3, 740, 000. 00	3, 541, 936. 25	
1. 4 SPAIN GOVT 280730	4, 240, 000. 00	4, 002, 831. 36	
1. 45 BEL GOVT 370622	1, 220, 000. 00	1, 010, 255. 16	
1. 45 ITALY GOVT 250515	2, 300, 000. 00	2, 249, 907. 15	
1. 45 ITALY GOVT 360301	2, 140, 000. 00	1, 632, 006. 80	
1. 45 SPAIN GOVT 271031	4, 330, 000. 00	4, 134, 652. 05	
1. 45 SPAIN GOVT 290430	3, 300, 000. 00	3, 088, 816. 50	
1. 45 SPAIN GOVT 711031	1, 300, 000. 00	633, 347. 00	
1. 5 AUSTRIA GOVT 470220	1, 810, 000. 00	1, 350, 384. 89	
1. 5 AUSTRIA GOVT 861102	460, 000. 00	278, 773. 34	
1. 5 FINNISH GOVT 320915	750, 000. 00	682, 344. 90	
1. 5 IRISH GOVT 500515	1, 460, 000. 00	1, 068, 384. 20	

1. 5 ITALY GOVT 250601	3, 300, 000. 00	3, 227, 248. 20	
1. 5 ITALY GOVT 450430	2, 010, 000. 00	1, 252, 563. 66	
1. 5 O. A. T 310525	9, 560, 000. 00	8, 902, 348. 48	
1. 5 O. A. T 500525	5, 230, 000. 00	3, 650, 487. 70	
1. 5 SPAIN GOVT 270430	4, 290, 000. 00	4, 127, 164. 47	
1. 6 BEL GOVT 470622	1, 570, 000. 00	1, 143, 668. 07	
1. 6 ITALY GOVT 260601	4, 120, 000. 00	3, 992, 778. 52	
1. 6 SPAIN GOVT 250430	3, 510, 000. 00	3, 444, 961. 17	
1. 65 ITALY GOVT 301201	3, 870, 000. 00	3, 455, 538. 48	
1. 65 ITALY GOVT 320301	4, 450, 000. 00	3, 866, 609. 45	
1. 7 BEL GOVT 500622	1, 840, 000. 00	1, 323, 685. 88	
1. 7 BUND 320815	4, 350, 000. 00	4, 197, 075. 75	
1. 7 IRISH GOVT 370515	1, 190, 000. 00	1, 045, 330. 51	
1. 7 ITALY GOVT 510901	2, 390, 000. 00	1, 437, 371. 83	
1. 75 O. A. T 390625	5, 470, 000. 00	4, 628, 817. 93	
1. 75 O. A. T 660525	2, 590, 000. 00	1, 767, 586. 94	
1. 8 BUND 530815	4, 060, 000. 00	3, 519, 147. 10	
1. 8 BUND 530815	1, 000, 000. 00	867, 934. 50	
1. 8 ITALY GOVT 410301	2, 950, 000. 00	2, 100, 400. 00	
1. 85 AUSTRIA GOVT 490523	870, 000. 00	688, 396. 20	
1. 85 ITALY GOVT 250701	4, 650, 000. 00	4, 565, 574. 60	
1. 85 SPAIN GOVT 350730	3, 510, 000. 00	3, 032, 675. 10	
1. 9 BEL GOVT 380622	1, 360, 000. 00	1, 175, 789. 36	
1. 9 SPAIN GOVT 521031	2, 920, 000. 00	1, 946, 413. 60	
1. 95 SPAIN GOVT 260430	3, 520, 000. 00	3, 454, 249. 92	
1. 95 SPAIN GOVT 300730	3, 790, 000. 00	3, 586, 541. 43	
2 AUSTRIA GOVT 260715	1, 000, 000. 00	985, 809. 00	
2 IRISH GOVT 450218	1, 640, 000. 00	1, 396, 294. 36	
2 ITALY GOVT 251201	3, 530, 000. 00	3, 465, 208. 36	
2 ITALY GOVT 280201	3, 880, 000. 00	3, 728, 453. 40	
2 NETH GOVT 540115	1, 310, 000. 00	1, 135, 316. 74	
2 O. A. T 321125	7, 450, 000. 00	7, 071, 785. 85	
2 O. A. T 480525	4, 970, 000. 00	3, 965, 070. 97	
2. 05 ITALY GOVT 270801	2, 650, 000. 00	2, 566, 482. 60	
2. 1 AUSTRIA GOVT 170920	950, 000. 00	718, 439. 40	
2. 1 BUND 291115	3, 800, 000. 00	3, 789, 272. 60	

2. 1 ITALY GOVT 260715	2, 350, 000. 00	2, 301, 719. 25	
2. 15 BEL GOVT 660622	1, 530, 000. 00	1, 155, 310. 65	
2. 15 ITALY GOVT 520901	1, 550, 000. 00	1, 015, 448. 40	
2. 15 ITALY GOVT 720301	850, 000. 00	509, 503. 60	
2. 15 SPAIN GOVT 251031	6, 000, 000. 00	5, 928, 468. 00	
2. 2 BUND 340215	420, 000. 00	420, 659. 40	
2. 2 ITALY GOVT 270601	2, 000, 000. 00	1, 950, 040. 00	
2. 2 OBL 280413	4, 250, 000. 00	4, 250, 807. 50	
2. 25 BEL GOVT 570622	1, 020, 000. 00	801, 700. 62	
2. 25 ITALY GOVT 360901	2, 720, 000. 00	2, 259, 400. 64	
2. 3 BUND 330215	6, 190, 000. 00	6, 251, 169. 58	
2. 3 BUND 330215	950, 000. 00	960, 029. 15	
2. 35 SPAIN GOVT 330730	3, 110, 000. 00	2, 915, 954. 66	
2. 4 AUSTRIA GOVT 340523	1, 690, 000. 00	1, 631, 683. 17	
2. 4 BUND 301115	2, 580, 000. 00	2, 618, 617. 44	
2. 4 IRISH GOVT 300515	1, 490, 000. 00	1, 488, 061. 00	
2. 4 OBL 281019	4, 820, 000. 00	4, 867, 491. 46	
2. 45 ITALY GOVT 330901	2, 870, 000. 00	2, 586, 590. 37	
2. 45 ITALY GOVT 500901	2, 490, 000. 00	1, 784, 194. 56	
2. 5 BUND 440704	4, 730, 000. 00	4, 747, 798. 99	
2. 5 BUND 460815	4, 950, 000. 00	4, 986, 733. 95	
2. 5 ITALY GOVT 251115	2, 330, 000. 00	2, 308, 419. 74	
2. 5 ITALY GOVT 321201	2, 850, 000. 00	2, 612, 700. 45	
2. 5 NETH GOVT 300115	600, 000. 00	603, 284. 40	
2. 5 NETH GOVT 330115	2, 750, 000. 00	2, 752, 641. 65	
2. 5 NETH GOVT 330715	1, 650, 000. 00	1, 646, 769. 46	
2. 5 O. A. T 260924	7, 300, 000. 00	7, 284, 531. 30	
2. 5 O. A. T 300525	9, 590, 000. 00	9, 585, 356. 80	
2. 5 O. A. T 430525	2, 110, 000. 00	1, 905, 653. 88	
2. 5 SCHATS 250313	1, 000, 000. 00	993, 467. 60	
2. 55 SPAIN GOVT 321031	4, 190, 000. 00	4, 027, 620. 74	
2. 6 BUND 330815	4, 310, 000. 00	4, 453, 803. 15	
2. 625 FINNISH GOV 420704	940, 000. 00	889, 782. 19	
2. 65 ITALY GOVT 271201	2, 800, 000. 00	2, 760, 618. 00	
2. 7 ITALY GOVT 470301	3, 300, 000. 00	2, 563, 776. 60	
2. 7 SPAIN GOVT 481031	2, 910, 000. 00	2, 424, 474. 26	

2. 75 BEL GOVT 390422	950, 000. 00	908, 799. 40	
2. 75 FINNISH GOVT 280704	1, 110, 000. 00	1, 121, 612. 82	
2. 75 FINNISH GOVT 380415	680, 000. 00	661, 465. 92	
2. 75 NETH GOVT 470115	3, 320, 000. 00	3, 366, 191. 16	
2. 75 O. A. T 271025	10, 320, 000. 00	10, 411, 641. 60	
2. 75 O. A. T 290225	5, 250, 000. 00	5, 310, 921. 00	
2. 8 ITALY GOVT 281201	3, 680, 000. 00	3, 625, 219. 52	
2. 8 ITALY GOVT 290615	3, 200, 000. 00	3, 129, 443. 80	
2. 8 ITALY GOVT 670301	1, 510, 000. 00	1, 089, 502. 75	
2. 8 SCHATS 250612	3, 470, 000. 00	3, 462, 739. 02	
2. 8 SPAIN GOVT 260531	3, 500, 000. 00	3, 498, 139. 40	
2. 875 FINNISH GOV 290415	600, 000. 00	609, 477. 60	
2. 9 AUSTRIA GOVT 290523	700, 000. 00	713, 898. 50	
2. 9 AUSTRIA GOVT 330220	2, 180, 000. 00	2, 208, 390. 14	
2. 9 AUSTRIA GOVT 340220	800, 000. 00	807, 184. 80	
2. 9 SPAIN GOVT 461031	2, 990, 000. 00	2, 621, 691. 80	
2. 95 FINNISH GOVT 550415	410, 000. 00	406, 302. 96	
2. 95 ITALY GOVT 380901	2, 380, 000. 00	2, 084, 653. 90	
3 BEL GOVT 330622	2, 750, 000. 00	2, 801, 232. 50	
3 BEL GOVT 340622	2, 050, 000. 00	2, 079, 495. 40	
3 FINNISH GOVT 330915	920, 000. 00	939, 897. 47	
3 IRISH GOVT 431018	690, 000. 00	701, 636. 16	
3 ITALY GOVT 290801	3, 400, 000. 00	3, 359, 181. 87	
3 O. A. T 330525	5, 500, 000. 00	5, 635, 525. 50	
3 O. A. T 490625	350, 000. 00	337, 316. 35	
3 O. A. T 540525	3, 450, 000. 00	3, 259, 911. 35	
3. 1 ITALY GOVT 400301	2, 310, 000. 00	2, 020, 670. 19	
3. 15 AUSTRIA GOVT 440620	1, 250, 000. 00	1, 266, 760. 00	
3. 15 AUSTRIA GOVT 531020	500, 000. 00	506, 848. 00	
3. 15 SPAIN GOVT 330430	3, 500, 000. 00	3, 508, 774. 50	
3. 25 BUND 420704	3, 120, 000. 00	3, 473, 882. 88	
3. 25 ITALY GOVT 380301	2, 220, 000. 00	2, 023, 192. 56	
3. 25 ITALY GOVT 460901	2, 740, 000. 00	2, 344, 437. 16	
3. 25 NETH GOVT 440115	500, 000. 00	541, 066. 50	
3. 25 O. A. T 450525	4, 710, 000. 00	4, 761, 004. 59	
3. 25 SPAIN GOVT 340430	1, 100, 000. 00	1, 103, 069. 00	

3. 3 BEL GOVT 540622	1, 690, 000. 00	1, 663, 990. 90	
3. 35 ITALY GOVT 350301	3, 110, 000. 00	2, 961, 668. 55	
3. 4 ITALY GOVT 250328	2, 300, 000. 00	2, 301, 940. 28	
3. 4 ITALY GOVT 280401	3, 000, 000. 00	3, 035, 176. 80	
3. 45 AUSTRIA GOVT 301020	700, 000. 00	735, 796. 60	
3. 45 BEL GOVT 430622	800, 000. 00	823, 417. 20	
3. 45 ITALY GOVT 480301	2, 820, 000. 00	2, 481, 036. 00	
3. 45 SPAIN GOVT 430730	1, 800, 000. 00	1, 736, 175. 60	
3. 45 SPAIN GOVT 660730	2, 230, 000. 00	2, 023, 999. 29	
3. 5 ITALY GOVT 260115	2, 500, 000. 00	2, 520, 640. 00	
3. 5 ITALY GOVT 300301	4, 470, 000. 00	4, 518, 304. 60	
3. 5 O. A. T 260425	6, 690, 000. 00	6, 814, 601. 25	
3. 5 O. A. T 331125	3, 230, 000. 00	3, 437, 737. 45	
3. 5 SPAIN GOVT 290531	1, 000, 000. 00	1, 033, 512. 60	
3. 55 SPAIN GOVT 331031	4, 120, 000. 00	4, 250, 818. 24	
3. 6 ITALY GOVT 250929	2, 000, 000. 00	2, 013, 848. 80	
3. 7 ITALY GOVT 300615	2, 350, 000. 00	2, 392, 523. 25	
3. 75 BEL GOVT 450622	1, 620, 000. 00	1, 744, 416. 00	
3. 75 NETH GOVT 420115	2, 940, 000. 00	3, 368, 675. 52	
3. 8 AUSTRIA GOVT 620126	700, 000. 00	813, 351. 00	
3. 8 ITALY GOVT 260415	2, 700, 000. 00	2, 744, 325. 90	
3. 8 ITALY GOVT 280801	3, 090, 000. 00	3, 174, 817. 41	
3. 85 ITALY GOVT 260915	1, 450, 000. 00	1, 480, 487. 70	
3. 85 ITALY GOVT 291215	2, 600, 000. 00	2, 672, 836. 40	
3. 85 ITALY GOVT 490901	2, 180, 000. 00	2, 031, 387. 22	
3. 9 SPAIN GOVT 390730	1, 670, 000. 00	1, 730, 355. 47	
4 BEL GOVT 320328	1, 250, 000. 00	1, 370, 987. 50	
4 BUND 370104	4, 440, 000. 00	5, 236, 713. 60	
4 FINNISH GOVT 250704	240, 000. 00	243, 696. 00	
4 ITALY GOVT 301115	2, 220, 000. 00	2, 297, 089. 05	
4 ITALY GOVT 311030	1, 650, 000. 00	1, 705, 515. 90	
4 ITALY GOVT 350430	2, 150, 000. 00	2, 177, 283. 50	
4 ITALY GOVT 370201	4, 950, 000. 00	4, 970, 834. 55	
4 NETH GOVT 370115	3, 160, 000. 00	3, 613, 302. 00	
4 O. A. T 381025	4, 020, 000. 00	4, 498, 950. 84	
4 O. A. T 550425	3, 260, 000. 00	3, 712, 253. 28	

4 O. A. T 600425	3, 180, 000. 00	3, 670, 820. 28	
4. 1 ITALY GOVT 290201	2, 230, 000. 00	2, 320, 950. 55	
4. 15 AUSTRIA GOVT 370315	2, 540, 000. 00	2, 863, 768. 72	
4. 2 ITALY GOVT 340301	2, 230, 000. 00	2, 309, 093. 18	
4. 2 SPAIN GOVT 370131	3, 460, 000. 00	3, 754, 487. 52	
4. 25 BEL GOVT 410328	2, 380, 000. 00	2, 718, 212. 28	
4. 25 BUND 390704	3, 010, 000. 00	3, 701, 592. 65	
4. 35 ITALY GOVT 331101	3, 270, 000. 00	3, 432, 945. 73	
4. 4 ITALY GOVT 330501	3, 800, 000. 00	4, 015, 999. 60	
4. 45 ITALY GOVT 430901	1, 450, 000. 00	1, 478, 718. 70	
4. 5 BEL GOVT 260328	1, 610, 000. 00	1, 670, 978. 75	
4. 5 ITALY GOVT 260301	3, 740, 000. 00	3, 848, 038. 87	
4. 5 ITALY GOVT 531001	2, 460, 000. 00	2, 503, 296. 00	
4. 5 O. A. T 410425	6, 030, 000. 00	7, 160, 287. 32	
4. 65 SPAIN GOVT 250730	2, 890, 000. 00	2, 957, 132. 96	
4. 7 SPAIN GOVT 410730	3, 300, 000. 00	3, 765, 418. 80	
4. 75 BUND 280704	2, 340, 000. 00	2, 589, 875. 26	
4. 75 BUND 340704	4, 170, 000. 00	5, 124, 696. 48	
4. 75 BUND 400704	3, 330, 000. 00	4, 355, 346. 96	
4. 75 ITALY GOVT 280901	3, 930, 000. 00	4, 197, 391. 30	
4. 75 ITALY GOVT 440901	3, 200, 000. 00	3, 397, 088. 00	
4. 75 O. A. T 350425	4, 900, 000. 00	5, 791, 677. 50	
4. 85 AUSTRIA GOVT 260315	1, 370, 000. 00	1, 429, 918. 32	
4. 9 SPAIN GOVT 400730	3, 310, 000. 00	3, 837, 865. 56	
5 BEL GOVT 350328	2, 950, 000. 00	3, 535, 185. 60	
5 ITALY GOVT 250301	4, 280, 000. 00	4, 352, 574. 24	
5 ITALY GOVT 340801	3, 850, 000. 00	4, 242, 000. 84	
5 ITALY GOVT 390801	3, 980, 000. 00	4, 354, 518. 00	
5 ITALY GOVT 400901	3, 600, 000. 00	3, 936, 117. 60	
5. 15 SPAIN GOVT 281031	3, 250, 000. 00	3, 590, 999. 75	
5. 15 SPAIN GOVT 441031	2, 640, 000. 00	3, 195, 426. 96	
5. 25 ITALY GOVT 291101	4, 660, 000. 00	5, 147, 734. 24	
5. 4 IRISH GOVT 250313	2, 100, 000. 00	2, 151, 513. 84	
5. 5 BEL GOVT 280328	3, 380, 000. 00	3, 777, 332. 52	
5. 5 BUND 310104	2, 470, 000. 00	2, 995, 262. 79	
5. 5 NETH GOVT 280115	2, 180, 000. 00	2, 430, 389. 35	

	5.5 O.A.T 290425	6,800,000.00	7,780,322.00	
	5.625 BUND 280104	2,540,000.00	2,861,223.64	
	5.75 ITALY GOVT 330201	3,820,000.00	4,427,227.20	
	5.75 O.A.T 321025	5,490,000.00	6,788,928.51	
	5.75 SPAIN GOVT 320730	3,980,000.00	4,789,651.40	
	5.9 SPAIN GOVT 260730	4,650,000.00	4,988,822.25	
	6 ITALY GOVT 310501	5,030,000.00	5,861,348.34	
	6 O.A.T 251025	5,760,000.00	6,063,830.20	
	6 SPAIN GOVT 290131	4,230,000.00	4,861,729.35	
	6.25 AUSTRIA GOVT 270715	1,630,000.00	1,826,242.70	
	6.25 BUND 300104	1,700,000.00	2,083,011.70	
	6.5 BUND 270704	2,680,000.00	3,046,238.08	
	6.5 ITALY GOVT 271101	3,900,000.00	4,375,059.00	
	7.25 ITALY GOVT 261101	2,300,000.00	2,555,907.20	
ユーロ合計		1,141,440,000.00	1,069,005,017.22 (171,329,434,109)	
合計			532,600,509,911 (532,600,509,911)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()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

種類	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 271 銘柄	100.00%	47.36%
カナダドル	国債証券 40 銘柄	100.00%	2.02%
オーストラリアドル	国債証券 27 銘柄	100.00%	1.36%
イギリスポンド	国債証券 59 銘柄	100.00%	5.24%
シンガポールドル	国債証券 19 銘柄	100.00%	0.41%
マレーシアリンギット	国債証券 28 銘柄	100.00%	0.50%
ニュージーランドドル	国債証券 10 銘柄	100.00%	0.23%
スウェーデンクローネ	国債証券 8 銘柄	100.00%	0.19%
ノルウェークローネ	国債証券 10 銘柄	100.00%	0.16%
デンマーククローネ	国債証券 7 銘柄	100.00%	0.27%
メキシコペソ	国債証券 16 銘柄	100.00%	0.85%
イスラエルシェケル	国債証券 11 銘柄	100.00%	0.33%
ポーランドズロチ	国債証券 13 銘柄	100.00%	0.51%
中国元	国債証券 77 銘柄	100.00%	8.40%

ユーロ	国債証券	371 銘柄	100.00%	32.17%
-----	------	--------	---------	--------

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

海外債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年2月5日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	62,631,720
コール・ローン	10,590,014
国債証券	3,652,824,764
地方債証券	11,542,329
特殊債券	280,045,966
社債券	350,474,721
派生商品評価勘定	6,065,022
未収利息	26,078,925
前払費用	3,852,812
流動資産合計	4,404,106,273
資産合計	4,404,106,273
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,100,156
未払金	17,476,322
未払解約金	1,690,000
未払利息	1
流動負債合計	28,266,479
負債合計	28,266,479
純資産の部	
元本等	
元本	1,489,905,541
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	2,885,934,253
元本等合計	4,375,839,794
純資産合計	4,375,839,794
負債純資産合計	4,404,106,273

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
--------------------	---

2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)
財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[2024 年 2 月 5 日現在]
1. 期首	2023 年 2 月 7 日
期首元本額	1, 066, 345, 266 円
期中追加設定元本額	459, 457, 776 円
期中一部解約元本額	35, 897, 501 円
元本の内訳※	
海外債券セレクション (ラップ向け)	421, 263, 769 円
アドバンスト・バランスⅠ (FOFs 用) (適格機関投資家限定)	4, 516, 047 円
アドバンスト・バランスⅡ (FOFs 用) (適格機関投資家限定)	8, 879, 174 円
三菱UFJ <DC>海外債券オープン	1, 055, 246, 551 円
合計	1, 489, 905, 541 円
2. 受益権の総数	1, 489, 905, 541 口

※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 2023 年 2 月 7 日 至 2024 年 2 月 5 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和 26 年法律第 198 号)第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、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。</p> <p>当ファンドは、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。</p> <p>また、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>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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、この結果はリスク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> <p>当ファンドは、ファンドの運用の指図に関する権限を再委託しております。この場合、再委託先で投資リスクに対する管理体制を構築しているほか、当該再委託先のリスクの管理体制や管理状況の確認を委託会社で行っております。</p>

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024 年 2 月 5 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。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 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。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2024 年 2 月 5 日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	49,326,758
地方債証券	426,507
特殊債券	5,891,303
社債券	10,544,400
合計	66,188,968

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[2024 年 2 月 5 日現在]

区分	種類	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				
	買建				
	アメリカドル	22,676,685	—	22,948,582	271,897
	カナダドル	77,373,725	—	78,068,204	694,479
	オーストラリアドル	89,831,059	—	89,506,300	△324,759
	スウェーデンクローネ	7,288,209	—	7,285,876	△2,333
	ノルウェークローネ	6,869,764	—	6,859,462	△10,302
	デンマーククローネ	2,211,828	—	2,241,099	29,271
	ポーランドズロチ	20,719,347	—	21,105,331	385,984
	オフショア元	209,979,844	—	214,563,991	4,584,147

	ユーロ	55,759,550	—	55,634,705	△124,845
	売建				
	アメリカドル	290,649,781	—	295,933,743	△5,283,962
	カナダドル	78,335,710	—	79,978,964	△1,643,254
	オーストラリアドル	10,403,468	—	10,309,025	94,443
	イギリスポンド	35,669,677	—	36,404,910	△735,233
	シンガポールドル	754,002	—	768,232	△14,230
	ニュージーランドドル	1,785,101	—	1,780,300	4,801
	メキシコペソ	7,483,526	—	7,618,946	△135,420
	ユーロ	67,684,346	—	68,510,164	△825,818
	合計	985,475,622	—	999,517,834	△3,035,134

(注) 時価の算定方法

- 1 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。
- ①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。
- ②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。
- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
- ※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(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。

(1口当たり情報)

	[2024 年 2 月 5 日現在]
1口当たり純資産額	2.9370 円
(1万口当たり純資産額)	(29,370 円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
アメリカドル	国債証券	0.5 T-NOTE 270430	1,970,000.00	1,756,570.51	
		0.5 T-NOTE 270630	965,000.00	855,966.30	

		1. 125 T-BOND 400515	875, 000. 00	552, 993. 16	
		1. 125 T-NOTE 261031	2, 200, 000. 00	2, 028, 125. 00	
		1. 25 T-BOND 500515	370, 000. 00	192, 400. 00	
		1. 25 T-NOTE 280331	940, 000. 00	840, 547. 26	
		1. 375 T-NOTE 311115	1, 945, 000. 00	1, 604, 890. 92	
		1. 5 T-NOTE 300215	1, 470, 000. 00	1, 273, 961. 69	
		2 T-NOTE 240531	310, 000. 00	306, 771. 59	
		2. 125 T-NOTE 250515	3, 710, 000. 00	3, 594, 642. 18	
		2. 5 T-BOND 450215	1, 085, 000. 00	806, 502. 53	
		2. 5 T-BOND 460515	99, 200. 00	72, 780. 25	
		3. 125 T-BOND 480515	380, 000. 00	309, 187. 88	
		3. 375 T-BOND 420815	750, 000. 00	657, 744. 14	
		4. 25 T-BOND 401115	195, 000. 00	195, 041. 89	
		4. 5 MEXICO 290422	200, 000. 00	194, 638. 90	
		5. 375 HUNGARY 240325	20, 000. 00	19, 989. 18	
	国債証券 小計		17, 484, 200. 00	15, 262, 753. 38 (2, 270, 487, 192)	
	特殊債券	2. 375 EXIM BK KO 240625	200, 000. 00	197, 848. 00	
		3. 5 SAUDI ARABIAN 290416	200, 000. 00	186, 991. 20	
		3. 875 EX-IM BK IN 280201	200, 000. 00	192, 303. 14	
	特殊債券 小計		600, 000. 00	577, 142. 34 (85, 855, 694)	
	社債券	1. 75 CVS HEALTH C 300821	50, 000. 00	41, 055. 73	
		1. 95 COMCAST CORP 310115	50, 000. 00	41, 867. 58	
		2. 4 AMERICAN TOWE 250315	75, 000. 00	72, 592. 12	
		2. 5 ENBRIDGE INC 250115	75, 000. 00	73, 069. 97	
		2. 9 ENERGY TRANSF 250515	50, 000. 00	48, 418. 46	
		2. 95 SINOPEC GRP 291112	200, 000. 00	186, 050. 00	
		3. 625 HCA INC 320315	60, 000. 00	53, 283. 51	
		4. 2 CHARTER COMM 280315	100, 000. 00	95, 707. 63	
		5. 65 ONEOK INC 281101	100, 000. 00	102, 644. 57	
		6. 875 PETRO MEX 251016	100, 000. 00	98, 864. 03	
		FRN BANK OF AM 310723	100, 000. 00	81, 770. 58	
		FRN CITIGROUP 310331	50, 000. 00	47, 905. 00	
	社債券 小計		1, 010, 000. 00	943, 229. 18 (140, 314, 772)	

アメリカドル合計			19, 094, 200. 00	16, 783, 124. 90 (2, 496, 657, 658)	
オーストラリアドル	国債証券	0. 5 AUST GOVT 260921	350, 000. 00	323, 498. 21	
		2. 75 AUST GOVT 291121	87, 000. 00	82, 800. 85	
	国債証券 小計		437, 000. 00	406, 299. 06 (39, 228, 174)	
	特殊債券	5. 25 VICTORIA 380915	270, 000. 00	274, 627. 69	
	特殊債券 小計		270, 000. 00	274, 627. 69 (26, 515, 303)	
オーストラリアドル合計			707, 000. 00	680, 926. 75 (65, 743, 477)	
イギリスポンド	国債証券	0. 375 GILT 301022	475, 000. 00	380, 318. 25	
		0. 5 GILT 290131	130, 000. 00	110, 705. 40	
		0. 625 GILT 501022	185, 000. 00	74, 629. 00	
		1. 5 GILT 470722	50, 000. 00	28, 284. 80	
		1. 75 GILT 490122	12, 500. 00	7, 359. 75	
		3. 5 GILT 450122	360, 000. 00	310, 858. 99	
		4. 625 GILT 340131	160, 000. 00	168, 304. 00	
	国債証券 小計		1, 372, 500. 00	1, 080, 460. 19 (202, 651, 113)	
	社債券	2. 25 LLOYDS BANKI 241016	100, 000. 00	97, 722. 00	
		2. 9 AT&T INC 261204	100, 000. 00	94, 465. 80	
		FRN NGG FINANCE P 730618	100, 000. 00	98, 867. 50	
	社債券 小計		300, 000. 00	291, 055. 30 (54, 590, 332)	
イギリスポンド合計			1, 672, 500. 00	1, 371, 515. 49 (257, 241, 445)	
シンガポールドル	国債証券	2. 625 SINGAPORGOV 320801	180, 000. 00	176, 850. 00	
シンガポールドル合計			180, 000. 00	176, 850. 00 (19, 566, 684)	
ニュージーランドドル	国債証券	4. 25 NZ GOVT 340515	115, 000. 00	112, 036. 43	
ニュージーランドドル合計			115, 000. 00	112, 036. 43 (10, 086, 639)	
デンマーククロー	国債証券	2. 25 DMK GOVT 331115	470, 000. 00	463, 816. 96	

ネ					
デンマーククローネ合計			470, 000. 00	463, 816. 96 (9, 972, 064)	
メキシコ ペソ	国債証券	7. 5 MEXICAN BONOS 270603	1, 500, 000. 00	1, 422, 210. 00	
		7. 75 MEXICAN BONO 310529	3, 250, 000. 00	3, 006, 607. 50	
		8. 5 MEXICAN BONOS 290531	566, 300. 00	550, 998. 57	
メキシコペソ合計			5, 316, 300. 00	4, 979, 816. 07 (43, 140, 146)	
ユーロ	国債証券	0 GRAND DUCHY OF 320914	20, 000. 00	16, 026. 32	
		0 ICELAND 280415	100, 000. 00	87, 544. 45	
		0 LATOVIA 310317	100, 000. 00	79, 344. 43	
		0 O. A. T 260225	410, 000. 00	388, 624. 65	
		0 O. A. T 301125	130, 000. 00	109, 651. 10	
		0 SPAIN GOVT 280131	75, 000. 00	67, 344. 52	
		0. 25 BUND 290215	620, 000. 00	565, 262. 06	
		0. 25 CHINA GOVT I 301125	100, 000. 00	83, 335. 00	
		0. 65 ITALY GO I/L 271028	80, 000. 00	76, 389. 65	
		0. 7 SPAIN GOVT 320430	78, 000. 00	64, 989. 60	
		0. 875 REPUBLIKA S 300715	80, 000. 00	70, 745. 13	
		0. 95 ITALY GOVT 300801	540, 000. 00	464, 235. 84	
		1. 2 ITALY GOVT 250815	832, 000. 00	808, 045. 88	
		1. 25 BUND 480815	115, 000. 00	90, 030. 85	
		1. 25 O. A. T 360525	210, 000. 00	174, 297. 48	
		1. 4 SPAIN GOVT 280430	70, 000. 00	66, 292. 92	
		1. 45 INDONESIA 260918	100, 000. 00	94, 418. 00	
		1. 45 SPAIN GOVT 711031	255, 000. 00	124, 233. 45	
		1. 5 AUSTRIA GOVT 470220	100, 000. 00	74, 606. 90	
		1. 6 ITALY GOV I/L 281122	40, 000. 00	38, 934. 92	
		1. 6 SPAIN GOVT 250430	380, 000. 00	372, 958. 75	
		1. 7 BEL GOVT 500622	65, 000. 00	46, 760. 64	
		1. 7 BUND 320815	120, 000. 00	115, 781. 40	
		2 O. A. T 480525	175, 000. 00	139, 615. 17	
		2. 7 SPAIN GOVT 481031	75, 000. 00	62, 486. 45	
		2. 75 FINNISH GOVT 280704	125, 000. 00	126, 307. 75	
		2. 8 ITALY GOVT 281201	100, 000. 00	98, 511. 40	
		3 BEL GOVT 340622	130, 000. 00	131, 870. 44	

	3 FINNISH GOVT 330915	190,000.00	194,109.26	
	3 GRAND DUCHY OF 330302	30,000.00	30,805.89	
	3.25 GRAND DUCHY 430302	85,000.00	88,142.02	
	3.25 O. A. T 450525	150,000.00	151,624.35	
	3.25 REPUBLIC OF 340117	170,000.00	169,286.51	
	3.3 BEL GOVT 540622	100,000.00	98,461.00	
	3.375 HELLENIC GO 340615	110,000.00	109,542.40	
	3.45 BEL GOVT 430622	60,000.00	61,756.29	
	3.45 SPAIN GOVT 430730	89,000.00	85,844.23	
	3.45 SPAIN GOVT 660730	50,000.00	45,381.15	
	3.55 SPAIN GOVT 331031	167,000.00	172,302.58	
	3.625 POLAND 340111	170,000.00	169,812.15	
	3.75 NETH GOVT 420115	100,000.00	114,580.80	
	3.875 LATOVIA 290522	63,000.00	64,719.90	
	3.875 LITHUANIA 330614	73,000.00	76,140.27	
	4 HUNGARY 290725	31,000.00	30,776.95	
	4.25 POLAND 430214	25,000.00	25,577.00	
	4.45 ITALY GOVT 430901	107,000.00	109,119.24	
	4.5 ITALY GOVT 531001	160,000.00	162,816.00	
国債証券 小計		7,155,000.00	6,599,443.14 (1,057,692,752)	
地方債証券	1.65 LAND NORDRHE 380222	85,000.00	72,018.03	
地方債証券 小計		85,000.00	72,018.03 (11,542,329)	
特殊債券	0 EIB 310114	50,000.00	41,686.96	
	0 EUROPEAN U 301004	110,000.00	92,672.58	
	0.125 AGENCE FRAN 310929	200,000.00	161,013.00	
	2 KFW 291115	200,000.00	193,506.00	
	2.625 COUNCIL EUR 340111	130,000.00	127,738.00	
	2.75 CAISSE D'AMO 290225	100,000.00	100,087.00	
	3 EFSF 340904	100,000.00	101,143.40	
	3 EUROPEAN U 530304	30,000.00	28,374.15	
	3.65 ADIF ALTA VE 340430	100,000.00	99,757.00	
	3.75 ARAB BK ECO 270125	100,000.00	100,225.00	
特殊債券 小計		1,120,000.00	1,046,203.09 (167,674,969)	

社債券	0. 875 CHUBB INA H 270615	100, 000. 00	92, 511. 80	
	0. 875 THERMO FISH 311001	100, 000. 00	84, 198. 90	
	1. 375 GAS NETWORK 261205	100, 000. 00	94, 931. 40	
	1. 875 VOLKSWAGEN 270330	100, 000. 00	95, 308. 20	
	3. 125 BANCO SANTA 270119	100, 000. 00	98, 478. 90	
	3. 875 CREDIT AGR 310420	100, 000. 00	102, 674. 60	
	4 BANQUE FED 291121	100, 000. 00	103, 013. 20	
	FRN ASR NEDERLAND 450929	100, 000. 00	101, 385. 50	
	FRN BNP PARIBAS 290113	100, 000. 00	102, 742. 60	
	STEP AXA SA 490528	100, 000. 00	95, 427. 00	
社債券 小計		1, 000, 000. 00	970, 672. 10 (155, 569, 617)	
ユーロ合計		9, 360, 000. 00	8, 688, 336. 36 (1, 392, 479, 667)	
合計			4, 294, 887, 780 (4, 294, 887, 780)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()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

種類	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 17 銘柄	90.94%	52.86%
	特殊債券 3 銘柄	3.44%	2.00%
	社債券 12 銘柄	5.62%	3.27%
オーストラリアドル	国債証券 2 銘柄	59.67%	0.91%
	特殊債券 1 銘柄	40.33%	0.62%
イギリスポンド	国債証券 7 銘柄	78.78%	4.72%
	社債券 3 銘柄	21.22%	1.27%
シンガポールドル	国債証券 1 銘柄	100.00%	0.46%
ニュージーランドドル	国債証券 1 銘柄	100.00%	0.23%
デンマーククローネ	国債証券 1 銘柄	100.00%	0.23%
メキシコペソ	国債証券 3 銘柄	100.00%	1.00%
ユーロ	国債証券 47 銘柄	75.96%	24.63%
	地方債証券 1 銘柄	0.83%	0.27%
	特殊債券 10 銘柄	12.04%	3.90%
	社債券 10 銘柄	11.17%	3.62%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

新興国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年2月5日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	2,516,463,163
コール・ローン	211,251,225
国債証券	84,930,571,573
派生商品評価勘定	2,131,457
未収入金	406,592,988
未収利息	1,198,743,230
前払費用	112,004,526
流動資産合計	89,377,758,162
資産合計	89,377,758,162
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	429,193
未払金	1,426,259,777
未払解約金	17,495,486
未払利息	30
流動負債合計	1,444,184,486
負債合計	1,444,184,486
純資産の部	
元本等	
元本	49,255,926,791
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	38,677,646,885
元本等合計	87,933,573,676
純資産合計	87,933,573,676
負債純資産合計	89,377,758,162

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[2024 年 2 月 5 日現在]
1. 期首	2023 年 2 月 7 日
期首元本額	44,342,222,961 円
期中追加設定元本額	7,279,073,169 円
期中一部解約元本額	2,365,369,339 円
元本の内訳※	
eMAXIS バランス (8 資産均等型)	3,423,960,687 円
eMAXIS バランス (波乗り型)	303,813,174 円
三菱UFJ プライムバランス (8 資産) (確定拠出年金)	1,199,234,268 円
海外債券セレクション (ラップ向け)	521,700,608 円
eMAXIS Slim バランス (8 資産均等型)	17,097,699,894 円
つみたて 8 資産均等バランス	8,458,148,789 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,150,565 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,943,161 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	1,096,344 円
ラップ向けインデックス f 新興国債券	2,194,651,173 円
eMAXIS 新興国債券インデックス	3,123,207,995 円
三菱UFJ DC 新興国債券インデックスファンド	12,129,561,482 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	68,832,785 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	274,685,163 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	262,552,948 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	140,637,790 円
アドバンスト・バランス I (FOFs 用) (適格機関投資家限定)	6,099,084 円
アドバンスト・バランス II (FOFs 用) (適格機関投資家限定)	10,364,781 円
世界 8 資産バランスファンド VL (適格機関投資家限定)	36,586,100 円
合計	49,255,926,791 円
2. 受益権の総数	49,255,926,791 口

※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 2023 年 2 月 7 日 至 2024 年 2 月 5 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和 26 年法律第 198 号)第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、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。</p> <p>当ファンドは、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。</p> <p>また、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</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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、この結果はリスク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>
-------------------	---

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024 年 2 月 5 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。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <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>(2) デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</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>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2024 年 2 月 5 日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	191,067,656
合計	191,067,656

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[2024 年 2 月 5 日現在]					
区分	種類	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				
	買建				
	アメリカドル	6,332,268	—	6,396,912	64,644
	マレーシアリンギット	61,940,000	—	62,490,600	550,600
	インドネシアルピア	58,585,631	—	59,742,754	1,157,123
	メキシコペソ	44,861,740	—	45,015,360	153,620
	チェココルナ	30,797,760	—	30,831,360	33,600
	ハンガリーフォリント	21,681,412	—	21,687,776	6,364

	ポーランドズロチ	25,882,420	—	25,962,660	80,240
	南アフリカランド	14,418,682	—	14,361,998	△56,684
	ルーマニアレイ	28,918,720	—	28,992,260	73,540
	トルコリラ	1,705,095	—	1,706,005	910
	売建				
	アメリカドル	32,440,060	—	32,719,808	△279,748
	エジプトポンド	6,332,268	—	6,414,213	△81,945
	合計	333,896,056	—	336,321,706	1,702,264

(注) 時価の算定方法

1 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。

①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。

②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。

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(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。

(1口当たり情報)

	[2024年2月5日現在]
1口当たり純資産額	1.7852円
(1万口当たり純資産額)	(17,852円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
マレーシアリングgit	国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	21,200,000.00	19,784,197.63	
		3.502MALAYSIAGOV 270531	14,600,000.00	14,609,497.30	
		3.582 MALAYSIAGOV 320715	14,700,000.00	14,445,829.79	
		3.733 MALAYSIAGO 280615	11,450,000.00	11,527,595.50	
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	13,700,000.00	13,207,346.90	
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	11,570,000.00	11,600,776.20	

		3. 882 MALAYSIAGOV 250314	6, 400, 000. 00	6, 443, 909. 76	
		3. 885 MALAYSIAGOV 290815	26, 250, 000. 00	26, 613, 381. 37	
		3. 899 MALAYSIAGOV 271116	13, 200, 000. 00	13, 382, 821. 32	
		3. 9 MALAYSIAGOV 261130	10, 720, 000. 00	10, 856, 582. 44	
		3. 906 MALAYSIAGOV 260715	19, 100, 000. 00	19, 335, 579. 40	
		3. 955 MALAYSIAGOV 250915	25, 600, 000. 00	25, 818, 560. 00	
		4. 065 MALAYSIAGOV 500615	9, 400, 000. 00	9, 237, 018. 00	
		4. 254 MALAYSIAGOV 350531	9, 550, 000. 00	9, 844, 061. 69	
		4. 369 MALAYSIA IN 281031	12, 800, 000. 00	13, 204, 211. 20	
		4. 457 MALAYSIAGOV 530331	5, 400, 000. 00	5, 641, 079. 76	
		4. 504 MALAYSIAGOV 290430	2, 800, 000. 00	2, 918, 519. 80	
		4. 696 MALAYSIAGOV 421015	14, 740, 000. 00	15, 989, 240. 05	
		4. 762 MALAYSIAGOV 370407	12, 400, 000. 00	13, 402, 062. 60	
		4. 893 MALAYSIAGOV 380608	8, 200, 000. 00	9, 035, 195. 42	
		4. 921 MALAYSIAGOV 480706	6, 100, 000. 00	6, 783, 584. 91	
マレーシアリングット合計			269, 880, 000. 00	273, 681, 051. 04 (8, 552, 040, 219)	
タイバーツ	国債証券	0. 75 THAILAND 240917	41, 300, 000. 00	40, 916, 122. 28	
		0. 95 THAILAND 250617	89, 000, 000. 00	87, 461, 229. 16	
		1 THAILAND 270617	114, 200, 000. 00	109, 493, 241. 29	
		1. 45 THAILAND 241217	120, 600, 000. 00	119, 723, 619. 09	
		1. 585 THAILAND 351217	78, 900, 000. 00	69, 777, 663. 26	
		1. 6 THAILAND 291217	90, 700, 000. 00	86, 740, 231. 18	
		1. 6 THAILAND 350617	38, 200, 000. 00	34, 041, 220. 24	
		2 THAILAND 311217	127, 900, 000. 00	123, 175, 495. 50	
		2 THAILAND 420617	57, 500, 000. 00	49, 800, 607. 40	
		2. 125 THAILAND 261217	96, 300, 000. 00	95, 969, 805. 59	
		2. 25 THAILAND 270317	58, 800, 000. 00	58, 790, 521. 44	
		2. 35 THAILAND 260617	85, 300, 000. 00	85, 539, 948. 90	
		2. 4 THAILAND 290317	52, 000, 000. 00	52, 108, 097. 60	
		2. 65 THAILAND 280617	98, 600, 000. 00	99, 940, 565. 60	
		2. 875 THAILAND 281217	84, 900, 000. 00	86, 918, 106. 96	
		2. 875 THAILAND 460617	67, 200, 000. 00	62, 756, 857. 63	
		3. 3 THAILAND 380617	94, 000, 000. 00	98, 497, 495. 80	
		3. 35 THAILAND 330617	91, 800, 000. 00	97, 154, 804. 16	
		3. 39 THAILAND 370617	78, 900, 000. 00	83, 689, 316. 79	

		3. 4 THAILAND 360617	70,000,000.00	74,170,047.00	
		3. 45 THAILAND 430617	63,300,000.00	66,929,305.50	
		3. 65 THAILAND 310620	78,100,000.00	84,166,979.82	
		3. 775 THAILAND 320625	88,600,000.00	96,324,777.06	
		3. 85 THAILAND 251212	74,700,000.00	76,845,899.43	
		4. 875 THAILAND 290622	76,300,000.00	85,762,420.80	
タイパーツ合計			2,017,100,000.00	2,026,694,379.48	
				(8,451,315,562)	
インドネ シアルピ ア	国債証券	10. 5 INDONESIA 300815	7,050,000,000.00	8,508,504,000.00	
		11 INDONESIA 250915	8,250,000,000.00	8,846,805,000.00	
		5. 125 INDONESIA 270415	31,300,000,000.00	30,193,545,000.00	
		5. 5 INDONESIA 260415	48,200,000,000.00	47,515,560,000.00	
		6. 125 INDONESIA 280515	29,000,000,000.00	28,820,200,000.00	
		6. 25 INDONESIA 360615	15,000,000,000.00	14,517,150,000.00	
		6. 375 INDONESIA 280815	25,000,000,000.00	25,026,750,000.00	
		6. 375 INDONESIA 320415	48,200,000,000.00	47,784,034,000.00	
		6. 375 INDONESIA 370715	4,000,000,000.00	3,942,780,000.00	
		6. 5 INDONESIA 250615	25,900,000,000.00	25,962,160,000.00	
		6. 5 INDONESIA 310215	47,600,000,000.00	47,338,200,000.00	
		6. 625 INDONESIA 330515	24,400,000,000.00	24,509,556,000.00	
		6. 625 INDONESIA 340215	11,500,000,000.00	11,612,010,000.00	
		6. 875 INDONESIA 290415	14,000,000,000.00	14,282,940,000.00	
		7 INDONESIA 270515	32,450,000,000.00	33,139,238,000.00	
		7 INDONESIA 300915	44,700,000,000.00	45,848,343,000.00	
		7 INDONESIA 330215	41,100,000,000.00	42,552,885,000.00	
		7. 125 INDONESIA 380615	13,700,000,000.00	14,258,206,500.00	
		7. 125 INDONESIA 420615	30,600,000,000.00	31,410,900,000.00	
		7. 125 INDONESIA 430615	13,500,000,000.00	14,010,435,000.00	
		7. 5 INDONESIA 320815	8,400,000,000.00	8,893,248,000.00	
		7. 5 INDONESIA 350615	44,800,000,000.00	47,802,048,000.00	
		7. 5 INDONESIA 380515	23,200,000,000.00	24,767,392,000.00	
		7. 5 INDONESIA 400415	30,400,000,000.00	32,391,808,000.00	
		8. 25 INDONESIA 290515	35,200,000,000.00	38,007,200,000.00	
		8. 25 INDONESIA 320615	18,000,000,000.00	19,827,000,000.00	
		8. 25 INDONESIA 360515	26,600,000,000.00	30,009,588,000.00	
		8. 375 INDONESIA 260915	40,930,000,000.00	42,951,942,000.00	

		8. 375 INDONESIA 340315	46, 700, 000, 000. 00	52, 824, 238, 000. 00	
		8. 375 INDONESIA 390415	23, 200, 000, 000. 00	26, 644, 736, 000. 00	
		8. 75 INDONESIA 310515	18, 400, 000, 000. 00	20, 698, 896, 000. 00	
		9 INDONESIA 290315	24, 600, 000, 000. 00	27, 295, 422, 000. 00	
		9. 5 INDONESIA 310715	15, 700, 000, 000. 00	18, 436, 981, 000. 00	
インドネシアルピア合計			871, 580, 000, 000. 00	910, 630, 700, 500. 00 (8, 650, 991, 654)	
メキシコ ペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	68, 700, 000. 00	68, 331, 914. 33	
		10 MEXICAN BONOS 361120	15, 700, 000. 00	16, 637, 133. 00	
		5 MEXICAN BONOS 250306	56, 000, 000. 00	53, 111, 520. 00	
		5. 5 MEXICAN BONOS 270304	86, 200, 000. 00	77, 154, 172. 00	
		5. 75 MEXICAN BONO 260305	120, 200, 000. 00	110, 935, 340. 99	
		7 MEXICAN BONOS 260903	30, 000, 000. 00	28, 149, 300. 00	
		7. 5 MEXICAN BONOS 270603	98, 200, 000. 00	93, 107, 348. 00	
		7. 5 MEXICAN BONOS 330526	68, 800, 000. 00	61, 512, 016. 00	
		7. 75 MEXICAN BONO 310529	108, 500, 000. 00	100, 374, 435. 00	
		7. 75 MEXICAN BONO 341123	24, 400, 000. 00	21, 988, 548. 00	
		7. 75 MEXICAN BONO 421113	81, 600, 000. 00	70, 308, 192. 00	
		8 MEXICAN BONOS 240905	19, 000, 000. 00	18, 644, 187. 19	
		8 MEXICAN BONOS 350524	10, 000, 000. 00	9, 105, 800. 00	
		8 MEXICAN BONOS 471107	66, 400, 000. 00	58, 165, 072. 00	
		8 MEXICAN BONOS 530731	54, 700, 000. 00	47, 526, 095. 00	
		8. 5 MEXICAN BONOS 290301	22, 000, 000. 00	21, 349, 460. 00	
		8. 5 MEXICAN BONOS 290531	75, 100, 000. 00	73, 070, 798. 00	
		8. 5 MEXICAN BONOS 381118	55, 500, 000. 00	52, 077, 870. 00	
メキシコペソ合計			1, 061, 000, 000. 00	981, 549, 201. 51 (8, 503, 160, 732)	
ブラジル リアル	国債証券	10 (IN)BRAZIL NT 270101	40, 270, 000. 00	40, 660, 507. 45	
		10 (IN)BRAZIL NTN 250101	25, 900, 000. 00	26, 134, 081. 35	
		10 (IN)BRAZIL NTN 310101	13, 300, 000. 00	13, 097, 440. 33	
		10 (IN)BRAZIL NTN 330101	20, 700, 000. 00	20, 270, 748. 44	
		10 (IN)BRAZIL NTN 350101	1, 000, 000. 00	969, 869. 51	
		10(IN) BRAZIL NTN 290101	42, 300, 000. 00	42, 305, 619. 13	
		BRAZIL-LTN 250701	33, 300, 000. 00	29, 217, 084. 32	
		BRAZIL-LTN 260101	52, 700, 000. 00	44, 097, 369. 49	
		BRAZIL-LTN 260701	61, 800, 000. 00	49, 370, 691. 30	

		BRAZIL-LTN 270701	29,200,000.00	21,151,891.61	
ブラジルレアル合計			320,470,000.00	287,275,302.93 (8,597,086,898)	
チリペソ	国債証券	2.3 BONOS TESORER 281001	480,000,000.00	428,520,000.00	
		2.5 BONOS TESORER 250301	1,860,000,000.00	1,823,823,000.00	
		4.5 BONOS TESORER 260301	1,420,000,000.00	1,432,425,000.00	
		4.7 BONOS TESORER 300901	1,570,000,000.00	1,558,146,500.00	
		5 BONOS TESORERIA 281001	410,000,000.00	413,153,588.00	
		5 BONOS TESORERIA 350301	1,470,000,000.00	1,455,904,331.00	
		6 BONOS TESORERIA 330401	950,000,000.00	1,020,358,805.00	
		6 BONOS TESORERIA 430101	1,315,000,000.00	1,431,837,750.00	
		7 BONOS TESORERIA 340501	350,000,000.00	402,798,525.00	
チリペソ合計			9,825,000,000.00	9,966,967,499.00 (1,561,455,029)	
チェココ ルナ	国債証券	0.05 CZECH REPUBL 291129	116,000,000.00	95,033,116.00	
		0.25 CZECH REPUBL 270210	143,500,000.00	129,645,075.00	
		1.5 CZECH REPUBLI 400424	20,500,000.00	14,700,550.00	
		1.75 CZECH REPUBL 320623	117,200,000.00	101,327,252.40	
		1.95 CZECH REPUBL 370730	24,300,000.00	19,502,329.50	
		3.5 CZECH REPUBLI 350530	81,500,000.00	79,382,630.00	
		4.5 CZECH REPUBLI 321111	21,000,000.00	22,261,470.00	
		4.9 CZECH REPUBLI 340414	32,000,000.00	34,948,800.00	
		5 CZECH REPUBLIC 300930	79,700,000.00	86,322,352.70	
		5.5 CZECH REPUBLI 281212	108,000,000.00	117,266,400.00	
		6 CZECH REPUBLIC 260226	118,500,000.00	123,762,585.00	
		6.2 CZECH REPUBLI 310616	5,000,000.00	5,827,450.00	
チェココルナ合計			867,200,000.00	829,980,010.60 (5,332,787,564)	
コロンビ アペソ	国債証券	13.25 TITULOS DE 330209	7,900,000,000.00	9,419,341,193.00	
		5.75 TITULOS DE T 271103	6,900,000,000.00	6,204,667,887.00	
		6 TITULOS DE TESO 280428	11,980,000,000.00	10,742,425,387.80	
		6.25 TITULOS DE T 251126	6,690,000,000.00	6,440,804,925.90	
		6.25 TITULOS DE T 360709	4,900,000,000.00	3,606,834,091.00	
		7 TITULOS DE TESO 310326	12,080,000,000.00	10,620,865,860.00	
		7 TITULOS DE TESO 320630	11,700,000,000.00	9,952,562,295.00	
		7.25 TITULOS DE T 341018	10,000,000,000.00	8,278,606,100.00	

		7. 25 TITULOS DE T 501026	9, 400, 000, 000. 00	6, 863, 383, 680. 00	
		7. 5 TITULOS DE TE 260826	11, 120, 000, 000. 00	10, 739, 398, 095. 20	
		7. 75 TITULOS DE T 300918	8, 340, 000, 000. 00	7, 740, 822, 708. 00	
		9. 25 TITULOS DE T 420528	12, 100, 000, 000. 00	10, 999, 285, 990. 00	
コロンビアペソ合計			113, 110, 000, 000. 00	101, 608, 998, 212. 90 (3, 840, 515, 305)	
ハンガリー フォリ ント	国債証券	1 HUNGARY 251126	427, 000, 000. 00	392, 978, 049. 10	
		1. 5 HUNGARY 260422	560, 000, 000. 00	511, 574, 000. 00	
		1. 5 HUNGARY 260826	270, 000, 000. 00	242, 365, 500. 00	
		2 HUNGARY 290523	330, 000, 000. 00	274, 840, 500. 00	
		2. 25 HUNGARY 330420	505, 000, 000. 00	380, 832, 721. 00	
		2. 25 HUNGARY 340622	150, 000, 000. 00	109, 482, 180. 00	
		2. 5 HUNGARY 241024	200, 000, 000. 00	194, 353, 460. 00	
		2. 75 HUNGARY 261222	373, 000, 000. 00	342, 355, 364. 40	
		3 HUNGARY 271027	541, 000, 000. 00	492, 296, 745. 50	
		3 HUNGARY 300821	518, 000, 000. 00	442, 015, 357. 00	
		3 HUNGARY 381027	392, 000, 000. 00	277, 177, 320. 00	
		3 HUNGARY 410425	205, 000, 000. 00	138, 047, 000. 00	
		3. 25 HUNGARY 311022	618, 000, 000. 00	521, 672, 463. 60	
		4. 5 HUNGARY 280323	260, 000, 000. 00	248, 032, 590. 00	
		4. 75 HUNGARY 321124	540, 000, 000. 00	500, 285, 770. 20	
		5. 5 HUNGARY 250624	492, 000, 000. 00	489, 580, 442. 40	
		6. 75 HUNGARY 281022	582, 000, 000. 00	605, 469, 382. 80	
		9. 5 HUNGARY 261021	180, 000, 000. 00	195, 491, 286. 00	
ハンガリーフォリント合計			7, 143, 000, 000. 00	6, 358, 850, 132. 00 (2, 653, 325, 600)	
ペルーヌ エボソル	国債証券	5. 35 PERU 400812	3, 250, 000. 00	2, 793, 810. 98	
		5. 4 PERU 340812	5, 200, 000. 00	4, 702, 774. 49	
		5. 94 PERU 290212	6, 600, 000. 00	6, 705, 523. 70	
		6. 15 PERU 320812	6, 900, 000. 00	6, 752, 633. 31	
		6. 35 PERU 280812	4, 900, 000. 00	5, 103, 213. 04	
		6. 9 PERU 370812	7, 000, 000. 00	7, 064, 199. 87	
		6. 95 PERU 310812	6, 800, 000. 00	7, 090, 214. 14	
		7. 3 PERU 330812	6, 400, 000. 00	6, 721, 906. 93	
ペルーヌエボソル合計			47, 050, 000. 00	46, 934, 276. 46 (1, 821, 871, 276)	

ポーランド ズロチ	国債証券	0 POLAND 251025	10,700,000.00	9,856,855.40	
		0.25 POLAND 261025	12,200,000.00	10,784,324.20	
		0.75 POLAND 250425	12,500,000.00	11,892,387.50	
		1.25 POLAND 301025	15,100,000.00	11,918,143.10	
		1.75 POLAND 320425	13,100,000.00	10,175,726.30	
		2.25 POLAND 241025	7,500,000.00	7,366,822.50	
		2.5 POLAND 260725	17,000,000.00	16,057,826.00	
		2.5 POLAND 270725	10,900,000.00	10,067,349.00	
		2.75 POLAND 280425	14,750,000.00	13,541,326.00	
		2.75 POLAND 291025	19,200,000.00	17,106,624.00	
		3.25 POLAND 250725	14,500,000.00	14,142,937.50	
		3.75 POLAND 270525	12,900,000.00	12,439,998.90	
		6 POLAND 331025	14,500,000.00	15,314,009.70	
		7.5 POLAND 280725	17,000,000.00	18,648,350.60	
ポーランドズロチ合計			191,850,000.00	179,312,680.70 (6,652,285,278)	
南アフリ カランド	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	127,600,000.00	133,284,580.00	
		11.625 SOUTH AFRI 530331	12,200,000.00	11,604,884.00	
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	39,800,000.00	26,194,370.00	
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	35,300,000.00	21,266,485.00	
		7 SOUTH AFRICA 310228	71,000,000.00	59,636,450.00	
		8 SOUTH AFRICA 300131	135,300,000.00	124,827,780.00	
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	122,700,000.00	107,000,535.00	
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	103,400,000.00	80,755,400.00	
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	97,200,000.00	71,636,400.00	
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	146,200,000.00	107,062,260.00	
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	112,500,000.00	94,826,250.00	
		9 SOUTH AFRICA 400131	88,900,000.00	69,093,080.00	
		南アフリカランド合計			1,092,100,000.00
ウルグアイ ペソ	国債証券	8.25 URUGUAY 310521	17,000,000.00	16,066,262.42	
		8.5 URUGUAY(GL) 280315	7,000,000.00	6,829,168.71	
		9.75 URUGUAY 330720	17,000,000.00	17,552,250.10	
ウルグアイペソ合計			41,000,000.00	40,447,681.23 (153,907,471)	
中国元	国債証券	1.99 CHINA GOVT 250409	14,000,000.00	13,992,937.84	

2. 18 CHINA GOVT 250825	3, 000, 000. 00	3, 002, 467. 20	
2. 18 CHINA GOVT 260815	8, 000, 000. 00	7, 998, 868. 64	
2. 24 CHINA GOVT 250525	3, 000, 000. 00	3, 006, 441. 00	
2. 28 CHINA GOVT 251125	4, 000, 000. 00	4, 007, 168. 00	
2. 3 CHINA GOVT 260515	5, 000, 000. 00	5, 012, 275. 00	
2. 37 CHINA GOVT 270120	8, 000, 000. 00	8, 037, 656. 00	
2. 4 CHINA GOVT 280715	5, 000, 000. 00	5, 010, 085. 50	
2. 44 CHINA GOVT 271015	5, 000, 000. 00	5, 025, 792. 50	
2. 46 CHINA GOVT 260215	8, 000, 000. 00	8, 045, 962. 40	
2. 48 CHINA GOVT 270415	5, 000, 000. 00	5, 027, 265. 00	
2. 48 CHINA GOVT 280925	3, 000, 000. 00	3, 022, 732. 50	
2. 5 CHINA GOVT 270725	7, 000, 000. 00	7, 047, 674. 90	
2. 52 CHINA GOVT 330825	9, 000, 000. 00	9, 049, 335. 30	
2. 54 CHINA GOVT 301225	1, 000, 000. 00	1, 006, 712. 20	
2. 55 CHINA GOVT 281015	6, 000, 000. 00	6, 063, 636. 00	
2. 6 CHINA GOVT 300915	7, 000, 000. 00	7, 076, 650. 70	
2. 6 CHINA GOVT 320901	5, 000, 000. 00	5, 039, 196. 00	
2. 62 CHINA GOVT 280415	7, 000, 000. 00	7, 095, 281. 20	
2. 62 CHINA GOVT 290925	6, 000, 000. 00	6, 072, 637. 20	
2. 62 CHINA GOVT 300625	5, 000, 000. 00	5, 054, 725. 00	
2. 64 CHINA GOVT 280115	7, 000, 000. 00	7, 091, 527. 80	
2. 67 CHINA GOVT 330525	7, 000, 000. 00	7, 111, 171. 20	
2. 67 CHINA GOVT 331125	8, 000, 000. 00	8, 170, 254. 40	
2. 68 CHINA GOVT 300521	16, 000, 000. 00	16, 232, 432. 00	
2. 69 CHINA GOVT 260812	10, 000, 000. 00	10, 117, 859. 00	
2. 69 CHINA GOVT 320815	7, 000, 000. 00	7, 109, 926. 60	
2. 75 CHINA GOVT 290615	3, 000, 000. 00	3, 056, 719. 20	
2. 75 CHINA GOVT 320217	6, 000, 000. 00	6, 119, 050. 20	
2. 76 CHINA GOVT 320515	5, 000, 000. 00	5, 105, 839. 50	
2. 79 CHINA GOVT 291215	4, 000, 000. 00	4, 083, 809. 20	
2. 8 CHINA GOVT 290324	2, 000, 000. 00	2, 044, 912. 40	
2. 8 CHINA GOVT 300325	4, 000, 000. 00	4, 082, 508. 00	
2. 8 CHINA GOVT 321115	6, 000, 000. 00	6, 145, 391. 40	
2. 85 CHINA GOVT 270604	12, 000, 000. 00	12, 231, 948. 00	
2. 88 CHINA GOVT 330225	7, 000, 000. 00	7, 224, 339. 50	
2. 89 CHINA GOVT 311118	5, 000, 000. 00	5, 148, 880. 50	

		2. 91 CHINA GOVT 281014	4, 000, 000. 00	4, 105, 668. 80	
		2. 94 CHINA GOVT 241017	4, 000, 000. 00	4, 029, 075. 20	
		3 CHINA GOVT 531015	1, 000, 000. 00	1, 076, 131. 20	
		3. 01 CHINA GOVT 280513	12, 000, 000. 00	12, 365, 817. 60	
		3. 02 CHINA GOVT 251022	15, 000, 000. 00	15, 240, 315. 00	
		3. 02 CHINA GOVT 310527	10, 000, 000. 00	10, 379, 138. 00	
		3. 03 CHINA GOVT 260311	7, 000, 000. 00	7, 135, 464. 00	
		3. 12 CHINA GOVT 261205	7, 000, 000. 00	7, 188, 415. 50	
		3. 12 CHINA GOVT 521025	4, 000, 000. 00	4, 336, 843. 60	
		3. 13 CHINA GOVT 291121	14, 000, 000. 00	14, 580, 273. 40	
		3. 19 CHINA GOVT 530415	4, 000, 000. 00	4, 436, 666. 80	
		3. 22 CHINA GOVT 251206	9, 000, 000. 00	9, 193, 817. 70	
		3. 25 CHINA GOVT 260606	12, 200, 000. 00	12, 525, 802. 22	
		3. 25 CHINA GOVT 281122	10, 000, 000. 00	10, 461, 753. 00	
		3. 27 CHINA GOVT 301119	10, 000, 000. 00	10, 554, 208. 00	
		3. 28 CHINA GOVT 271203	11, 000, 000. 00	11, 453, 740. 10	
		3. 29 CHINA GOVT 290523	15, 000, 000. 00	15, 733, 254. 00	
		3. 32 CHINA GOVT 520415	5, 000, 000. 00	5, 616, 999. 50	
		3. 53 CHINA GOVT 511018	4, 000, 000. 00	4, 646, 068. 80	
		3. 72 CHINA GOVT 510412	4, 000, 000. 00	4, 781, 782. 00	
		3. 81 CHINA GOVT 500914	8, 000, 000. 00	9, 677, 731. 20	
中国元合計			403, 200, 000. 00	415, 291, 034. 60 (8, 584, 647, 092)	
ドミ ニカ ペソ	国債証券	11. 25 DOMINICAN 350915	32, 000, 000. 00	34, 532, 747. 84	
		13. 625 DOMINICAN 330203	16, 000, 000. 00	19, 435, 771. 52	
ドミニカペソ合計			48, 000, 000. 00	53, 968, 519. 36 (136, 432, 416)	
セル ビア ディ ナール	国債証券	4. 5 SERBIA TREASU 260111	61, 000, 000. 00	60, 618, 750. 00	
		4. 5 SERBIA TREASU 320820	74, 000, 000. 00	66, 877, 500. 00	
		5. 875 SERBIA TREA 280208	50, 000, 000. 00	51, 687, 500. 00	
セルビアディナール合計			185, 000, 000. 00	179, 183, 750. 00 (245, 298, 074)	
ルー マニ アレ イ	国債証券	2. 5 ROMANIA GOVER 271025	4, 000, 000. 00	3, 538, 403. 76	
		3. 25 ROMANIA GOVE 260624	3, 200, 000. 00	2, 948, 688. 16	
		3. 5 ROMANIA GOVER 251125	4, 500, 000. 00	4, 323, 365. 64	
		3. 65 ROMANIA GOVE 250728	4, 000, 000. 00	3, 878, 122. 00	

		3. 65 ROMANIA GOVE 310924	5, 500, 000. 00	4, 659, 883. 03		
		4. 15 ROMANIA GOVE 280126	5, 200, 000. 00	4, 864, 343. 79		
		4. 15 ROMANIA GOVE 301024	5, 000, 000. 00	4, 504, 964. 30		
		4. 25 ROMANIA GOVE 360428	3, 800, 000. 00	3, 130, 243. 92		
		4. 75 ROMANIA GOVE 250224	6, 900, 000. 00	6, 824, 052. 45		
		4. 75 ROMANIA GOVE 341011	5, 200, 000. 00	4, 590, 536. 13		
		4. 85 ROMANIA GOVE 260422	4, 900, 000. 00	4, 698, 775. 62		
		4. 85 ROMANIA GOVE 290725	4, 800, 000. 00	4, 525, 728. 00		
		5 ROMANIA GOVERNMENT 290212	6, 260, 000. 00	5, 950, 501. 78		
		5. 8 ROMANIA GOV 270726	5, 800, 000. 00	5, 753, 924. 74		
		6. 7 ROMANIA GOVERN 320225	5, 900, 000. 00	6, 064, 674. 31		
		7. 2 ROMANIA GOVERN 261028	3, 200, 000. 00	3, 289, 559. 04		
		7. 2 ROMANIA GOVERN 270531	2, 500, 000. 00	2, 586, 954. 75		
		7. 2 ROMANIA GOVERN 331030	3, 200, 000. 00	3, 452, 208. 32		
		7. 35 ROMANIA GOVE 310428	2, 800, 000. 00	3, 003, 562. 52		
		7. 9 ROMANIA GOVERN 380224	4, 400, 000. 00	4, 992, 108. 00		
		8 ROMANIA GOVERNMENT 300429	2, 900, 000. 00	3, 158, 013. 00		
		8. 25 ROMANIA GOVE 320929	5, 200, 000. 00	5, 842, 626. 92		
		8. 75 ROMANIA GOVE 281030	5, 500, 000. 00	6, 067, 849. 70		
		ルーマニアレイ合計			104, 660, 000. 00	102, 649, 089. 88 (3, 307, 641, 093)
トルコリラ	国債証券	10. 5 TURKEY GOVT 270811	23, 900, 000. 00	15, 331, 850. 00		
		10. 6 TURKEY GOVT 260211	9, 600, 000. 00	6, 355, 200. 00		
		11 TURKEY GOVT 270224	4, 500, 000. 00	2, 866, 500. 00		
		11. 7 TURKEY GOVT 301113	14, 100, 000. 00	8, 939, 400. 00		
		12. 4 TURKEY GOVT 280308	29, 100, 000. 00	19, 409, 700. 00		
		12. 6 TURKEY GOVT 251001	39, 600, 000. 00	27, 522, 000. 00		
		16. 9 TURKEY GOVT 260902	17, 200, 000. 00	12, 762, 400. 00		
		17. 3 TURKEY GOVT 280719	48, 000, 000. 00	37, 440, 000. 00		
		17. 8 TURKEY GOVT 330713	28, 000, 000. 00	21, 056, 000. 00		
		8 TURKEY GOVT 250312	6, 300, 000. 00	4, 737, 600. 00		
トルコリラ合計			220, 300, 000. 00	156, 420, 650. 00 (764, 380, 790)		
合計				84, 930, 571, 573 (84, 930, 571, 573)		

(注 1) 通貨の種類ごとの小計／合計欄の()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

種類	銘柄数		組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
マレーシアリングgit	国債証券	21 銘柄	100.00%	10.07%
タイバーツ	国債証券	25 銘柄	100.00%	9.95%
インドネシアルピア	国債証券	33 銘柄	100.00%	10.19%
メキシコペソ	国債証券	18 銘柄	100.00%	10.01%
ブラジルリアル	国債証券	10 銘柄	100.00%	10.12%
チリペソ	国債証券	9 銘柄	100.00%	1.84%
チェココルナ	国債証券	12 銘柄	100.00%	6.28%
コロンビアペソ	国債証券	12 銘柄	100.00%	4.52%
ハンガリーフォリント	国債証券	18 銘柄	100.00%	3.12%
ペルーヌエボソル	国債証券	8 銘柄	100.00%	2.15%
ポーランドズロチ	国債証券	14 銘柄	100.00%	7.83%
南アフリカランド	国債証券	12 銘柄	100.00%	8.39%
ウルグアイペソ	国債証券	3 銘柄	100.00%	0.18%
中国元	国債証券	58 銘柄	100.00%	10.11%
ドミニカペソ	国債証券	2 銘柄	100.00%	0.16%
セルビアディナール	国債証券	3 銘柄	100.00%	0.29%
ルーマニアレイ	国債証券	23 銘柄	100.00%	3.89%
トルコリラ	国債証券	10 銘柄	100.00%	0.90%

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記) に記載しております。

2 【ファンドの現況】

【海外債券セクション (ラップ向け)】

【純資産額計算書】

2024 年 2 月 29 日現在

(単位：円)

I 資産総額	26,078,195,374
II 負債総額	104,795,293
III 純資産総額 (I - II)	25,973,400,081
IV 発行済口数	18,930,572,502口

V 1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3720
（10,000口当たり）	（13,720）

（参考）

外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年2月29日現在

（単位：円）

I 資産総額	551,541,622,122
II 負債総額	2,224,535,762
III 純資産総額（I－II）	549,317,086,360
IV 発行済口数	210,211,582,863口
V 1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	2.6132
（10,000口当たり）	（26,132）

海外債券マザーファンド

純資産額計算書

2024年2月29日現在

（単位：円）

I 資産総額	4,430,775,222
II 負債総額	30,106,019
III 純資産総額（I－II）	4,400,669,203
IV 発行済口数	1,489,905,541口
V 1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	2.9537
（10,000口当たり）	（29,537）

新興国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年2月29日現在

（単位：円）

I 資産総額	89,780,333,133
II 負債総額	330,172,042
III 純資産総額（I－II）	89,450,161,091
IV 発行済口数	49,601,636,239口
V 1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8034
（10,000口当たり）	（18,034）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、委託会社は、この信託の受益権を取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。なお、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、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

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡

①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。

②上記①の申請のある場合には、上記①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①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。

③上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたと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) 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がって取り扱われます。

第三部【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

2024 年 2 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、211,581 株を発行済です。最近 5 年間に於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

①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。

②運用戦略の決定

運用戦略・管理委員会において、①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。

③運用計画の決定

②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。

④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。

⑤運用部門による自律的な運用管理

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、運用部門内の管理担当部署は逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また、運用戦略・管理委員会を通じて運用状況のモニタリングを行い、運用部門内での自律的牽制により運用改善を図ります。

⑥管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署は、(a) 運用に関するパフォーマンス測定・分析のほか、(b) 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、(a) についてはファンド管理委員会を経て運用担当部・商品開発担当部にフィードバックされ、(b) についてはリスク管理委員会を通じて運用担当部にフィードバックされ、必要に応じて部署間連携の上で是正・改善の検討が行われます。

⑦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、商品企画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。

⑧運用・管理に関する監督

内部監査担当部署は、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。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

2 【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

ます。

2024 年 2 月 29 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	840	32,364,511
追加型公社債投資信託	16	1,593,094
単位型株式投資信託	97	444,511
単位型公社債投資信託	49	94,595
合 計	1,002	34,496,710

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アセットマネジメント株式会社（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 38 期事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 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 39 期事業年度に係る中間会計期間（自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 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。

独立監査人の監査報告書

2023 年 6 月 9 日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御 中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 青 木 裕 晃

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 伊 藤 鉄 也

監査意見

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国際投信株式会社の 2022 年 4 月 1 日から 2023 年 3 月 31 日までの第 38 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。

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国際投信株式会社の 2023 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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行

を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

会社と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) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023 年 12 月 1 日

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

山 田 信 之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

田 嶋 大 士

中間監査意見

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アセットマネジメント株式会社の 2023 年 4 月 1 日から 2024 年 3 月 31 日までの第 39 期事業年度の中間会計期間（2023 年 4 月 1 日から 2023 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。

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アセットマネジメント株式会社の 2023 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（2023 年 4 月 1 日から 2023 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。

中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間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、監査人は、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。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

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) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRL データは中間監査の対象には含まれていません。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

		第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)		第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	※2	51,593,362	※2	51,733,041
有価証券		293,326		1,579,691
前払費用		645,109		770,747
未収入金		61,092		81,854
未収委託者報酬		15,750,264		16,753,855
未収収益	※2	783,790	※2	688,142
金銭の信託		8,401,300		10,400,000
その他		295,584		745,576
流動資産合計		77,823,830		82,752,908
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	391,042	※1	181,551
器具備品	※1	1,079,023	※1	730,357
土地		628,433		628,433
建設仮勘定		-		1,111,177
有形固定資産合計		2,098,499		2,651,520
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		4,381,293		4,183,644
ソフトウェア仮勘定		1,581,652		1,907,739
無形固定資産合計		5,978,768		6,107,206
投資その他の資産				
投資有価証券		16,803,642		12,022,365
関係会社株式		159,536		159,536
投資不動産	※1	810,684	※1	807,066
長期差入保証金		524,244		689,492
前払年金費用		189,708		118,832
繰延税金資産		982,406		1,675,132
その他		45,230		45,230
貸倒引当金		△23,600		△23,600
投資その他の資産合計		19,491,852		15,494,056
固定資産合計		27,569,120		24,252,782
資産合計		105,392,950		107,005,691

(単位：千円)

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	565,222	507,559
未払金		
未払収益分配金	197,334	114,094
未払償還金	7,418	7,418
未払手数料	※2 6,423,139	※2 6,139,595
その他未払金	※2 4,565,457	※2 955,697
未払費用	※2 4,328,968	※2 5,778,896
未払消費税等	1,112,923	439,657
未払法人税等	769,692	2,375,281
賞与引当金	942,287	849,840
役員賞与引当金	149,028	154,872
その他	5,517	5,517
流動負債合計	19,066,990	17,328,431
固定負債		
長期未払金	10,800	-
退職給付引当金	1,246,300	1,333,882
役員退職慰労引当金	117,938	75,667
時効後支払損引当金	250,214	254,296
固定負債合計	1,625,252	1,663,846
負債合計	20,692,243	18,992,277
(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	3,572,096	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712	44,732,712
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	29,000,498	33,267,700
利益剰余金合計	36,341,088	40,608,289
株主資本合計	83,073,932	87,341,133

(単位：千円)

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,626,775	672,279
評価・換算差額等合計	1,626,775	672,279
純資産合計	84,700,707	88,013,413
負債純資産合計	105,392,950	107,005,691

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
営業収益		
委託者報酬	79,977,953	84,121,445
投資顧問料	2,711,169	2,750,601
その他営業収益	13,459	10,412
営業収益合計	82,702,582	86,882,459
営業費用		
支払手数料	※2 31,644,834	※2 31,461,274
広告宣伝費	720,785	798,894
公告費	500	375
調査費		
調査費	2,430,158	2,849,042
委託調査費	14,557,009	19,236,505
事務委託費	1,450,062	1,751,807
営業雑経費		
通信費	138,868	113,480
印刷費	379,428	367,379
協会費	49,590	58,128
諸会費	17,729	18,447
事務機器関連費	2,172,978	2,238,382
その他営業雑経費	649	-
営業費用合計	53,562,596	58,893,717
一般管理費		
給料		
役員報酬	414,260	416,461
給料・手当	6,496,233	6,565,766
賞与引当金繰入	942,287	849,840
役員賞与引当金繰入	149,028	154,872
福利厚生費	1,282,310	1,279,885
交際費	4,874	8,942
旅費交通費	21,698	75,274
租税公課	430,233	403,955
不動産賃借料	724,961	719,707
退職給付費用	494,615	388,176
固定資産減価償却費	2,249,287	2,418,341
諸経費	379,054	444,313
一般管理費合計	13,588,846	13,725,534
営業利益	15,551,139	14,263,207

(単位：千円)

	第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
営業外収益		
受取配当金	243,133	47,353
受取利息 ※2	7,408	※2 10,279
投資有価証券償還益	1,089,101	609,102
収益分配金等時効完成分	137,485	94,351
受取賃貸料 ※2	65,808	※2 65,808
その他	36,211	36,894
営業外収益合計	1,579,148	863,788
営業外費用		
投資有価証券償還損	3,074	32,995
時効後支払損引当金繰入	16,548	31,951
事務過誤費	76,076	2,680
賃貸関連費用	15,780	14,262
その他	7,585	32,394
営業外費用合計	119,066	114,284
経常利益	17,011,221	15,012,711
特別利益		
投資有価証券売却益	605,706	387,113
特別利益合計	605,706	387,113
特別損失		
投資有価証券売却損	28,188	15,828
投資有価証券評価損	36,558	104,554
固定資産除却損 ※1	13,094	※1 32,791
減損損失	-	※3 315,350
特別損失合計	77,840	468,524
税引前当期純利益	17,539,087	14,931,300
法人税、住民税及び事業税 ※2	5,366,608	※2 4,860,444
法人税等調整額	22,446	△271,471
法人税等合計	5,389,054	4,588,973
当期純利益	12,150,032	10,342,327

(3) 【株主資本等変動計算書】

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
会計方針の変更による累積的影響額				
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)				
当期変動額合計	—	—	—	—
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712

	利益剰余金				
	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	株主資本合計
		別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	342,589	6,998,000	26,951,289	34,291,879	81,024,723
会計方針の変更による累積的影響額			475,687	475,687	475,687
会計方針の変更を反映した当期首残高	342,589	6,998,000	27,426,976	34,767,566	81,500,410
当期変動額					
剰余金の配当			△10,576,511	△10,576,511	△10,576,511
当期純利益			12,150,032	12,150,032	12,150,032
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)					
当期変動額合計	—	—	1,573,521	1,573,521	1,573,521
当期末残高	342,589	6,998,000	29,000,498	36,341,088	83,073,932

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	2,301,606	2,301,606	83,326,329
会計方針の変更による累積的影響額			475,687
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,301,606	2,301,606	83,802,017
当期変動額			
剰余金の配当			△10,576,511
当期純利益			12,150,032
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	△674,831	△674,831	△674,831
当期変動額合計	△674,831	△674,831	898,690
当期末残高	1,626,775	1,626,775	84,700,707

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計
当期首残高	2, 000, 131	3, 572, 096	41, 160, 616	44, 732, 712
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）				
当期変動額合計	—	—	—	—
当期末残高	2, 000, 131	3, 572, 096	41, 160, 616	44, 732, 712

	利益剰余金				株主資本合計
	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
別途 積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	342, 589	6, 998, 000	29, 000, 498	36, 341, 088	83, 073, 932
当期変動額					
剰余金の配当			△6, 075, 125	△6, 075, 125	△6, 075, 125
当期純利益			10, 342, 327	10, 342, 327	10, 342, 327
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)					
当期変動額合計	—	—	4, 267, 201	4, 267, 201	4, 267, 201
当期末残高	342, 589	6, 998, 000	33, 267, 700	40, 608, 289	87, 341, 133

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1, 626, 775	1, 626, 775	84, 700, 707
当期変動額			
剰余金の配当			△6, 075, 125
当期純利益			10, 342, 327
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	△954, 495	△954, 495	△954, 495
当期変動額合計	△954, 495	△954, 495	3, 312, 705
当期末残高	672, 279	672, 279	88, 013, 413

[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

市場価格のない株式等以外のもの

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。

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	5年～50年
器具備品	2年～20年
投資不動産	5年～47年

(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。

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、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。

5. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 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。

(3) 役員賞与引当金

役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。

(4) 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。

①退職給付見込額の期間帰属方法

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

②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により費用処理することとしております。

数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(主として10年)による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。

(5) 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。

(6) 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。

6. 収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主要な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1) 委託者報酬

投資信託の信託約款に基づき信託財産の運用指図等を行っております。委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を投資信託によって主に年 2 回受領しております。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2) 投資顧問料

顧客との投資一任及び投資助言契約に基づき運用及び助言を行っております。投資顧問料は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を主に年 4 回受領しております。当該報酬は契約期間にわたり収益として認識しております。

7. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第 31 号 2021 年 6 月 17 日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第 27-2 項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。なお、時価算定会計基準適用指針の適用による、財務諸表への影響はありません。

(貸借対照表関係)

※1. 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
建物	805,250 千円	1,006,606 千円
器具備品	2,054,366 千円	1,985,072 千円
投資不動産	157,995 千円	163,978 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 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
預金	43,782,913 千円	40,165,058 千円
未収収益	13,741 千円	15,046 千円
未払手数料	836,105 千円	790,279 千円
その他未払金	3,887,520 千円	77,007 千円
未払費用	337,847 千円	277,358 千円

(損益計算書関係)

※1. 固定資産除却損の内訳

	第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
建物	2,599 千円	1,047 千円
器具備品	10,495 千円	29,762 千円
ソフトウェア	-	1,981 千円
計	13,094 千円	32,791 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 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
支払手数料	5,153,589 千円	4,893,312 千円
受取利息	7,377 千円	10,236 千円
受取賃貸料	65,808 千円	68,168 千円
法人税、住民税及び事業税	4,062,765 千円	3,947,200 千円

※3. 減損損失

当社は、以下のとおり減損損失を計上しました。

場所	用途	種類	金額
東京都千代田区 (本社)	ホームページ	ソフトウェア	315,350 千円

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を 1 つのグルーピングとしております。

翌期において、ホームページのリニューアルを予定しており、現行のホームページについて将来の利用終了が見込まれるため帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、回収可能価額として使用価値を用いておりますが、割引率については使用見込期間が短いため考慮していません。

(株主資本等変動計算書関係)

第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 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	211,581	—	—	211,581
合計	211,581	—	—	211,581

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

2021 年 6 月 28 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。

- ① 配当金の総額 10,576,511 千円
- ② 1 株当たり配当額 49,988 円
- ③ 基準日 2021 年 3 月 31 日
- ④ 効力発生日 2021 年 6 月 29 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

2022 年 6 月 28 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。

- ① 配当金の総額 6,075,125 千円
- ② 配当の原資 利益剰余金
- ③ 1 株当たり配当額 28,713 円
- ④ 基準日 2022 年 3 月 31 日
- ⑤ 効力発生日 2022 年 6 月 29 日

第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 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	211,581	—	—	211,581
合計	211,581	—	—	211,581

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

2022 年 6 月 28 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。

- ① 配当金の総額 6,075,125 千円
- ② 1 株当たり配当額 28,713 円
- ③ 基準日 2022 年 3 月 31 日
- ④ 効力発生日 2022 年 6 月 29 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

2023 年 6 月 28 日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

- ① 配当金の総額 5,171,039 千円
- ② 配当の原資 利益剰余金
- ③ 1 株当たり配当額 24,440 円
- ④ 基準日 2023 年 3 月 31 日
- ⑤ 効力発生日 2023 年 6 月 29 日

(リース取引関係)

〈借主側〉

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
1 年内	709,808 千円	962,809 千円
1 年超	414,054 千円	1,532,728 千円
合計	1,123,863 千円	2,495,537 千円

(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、金銭の信託（合同運用指定金銭信託）で運用し、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。

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、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（(注 2) 参照）。

第 37 期(2022 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) 有価証券	293,326	293,326	—
(2) 金銭の信託	8,401,300	8,401,300	—
(3) 投資有価証券	16,772,282	16,772,282	—
資産計	25,466,909	25,466,909	—

(注 1) 「現金及び預金」、「未収委託者報酬」、「未払手数料」については短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注 2) 市場価格のない株式等

非上場株式（前事業年度の貸借対照表計上額 31,360 千円）は、市場価格がないため、「(3) 投資有価証券」には含めておりません。また、関連会社株式（前事業年度の貸借対照表計上額 159,536 千円）は、市場価格がないため、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もあります。

(注 4) 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 37 期(2022 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	51,593,362	—	—	—
金銭の信託	8,401,300	—	—	—
未収委託者報酬	15,750,264	—	—	—
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				
投資信託	293,326	6,911,464	3,695,585	—
合計	76,038,253	6,911,464	3,695,585	—

第 38 期(2023 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) 有価証券	1, 579, 691	1, 579, 691	—
(2) 金銭の信託	10, 400, 000	10, 400, 000	—
(3) 投資有価証券	12, 022, 365	12, 022, 365	—
資産計	24, 002, 056	24, 002, 056	—

(注 1) 「現金及び預金」、「未収委託者報酬」、「未払手数料」については短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注 2) 市場価格のない株式等

関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額 159, 536 千円）は、市場価格がないため、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もあります。

(注 4) 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 38 期(2023 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	51, 733, 041	—	—	—
金銭の信託	10, 400, 000	—	—	—
未収委託者報酬	16, 753, 855	—	—	—
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				
投資信託	1, 579, 691	4, 859, 714	1, 433, 213	—
合計	80, 466, 587	4, 859, 714	1, 433, 213	—

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の 3 つのレベルに分類しております。

- レベル 1 の時価： 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル 2 の時価： 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル 1 のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル 3 の時価： 観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債
第 37 期(2022 年 3 月 31 日現在)

区分	時価 (千円)			
	レベル 1	レベル 2	レベル 3	合計
金銭の信託	—	8,401,300	—	8,401,300
資産計	—	8,401,300	—	8,401,300

※財務諸表等規則附則（2021 年 9 月 24 日内閣府令第 9 号）に基づく経過措置を適用した投資信託（貸借対照表計上額 有価証券 293,326 千円、投資有価証券 16,772,282 千円）は、表には含めておりません。

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しており、レベル 2 の時価に分類しております。

第 38 期(2023 年 3 月 31 日現在)

区分	時価 (千円)			
	レベル 1	レベル 2	レベル 3	合計
有価証券	—	1,579,691	—	1,579,691
金銭の信託	—	10,400,000	—	10,400,000
投資有価証券	1,794,704	10,227,661	—	12,022,365
資産計	1,794,704	22,207,352	—	24,002,056

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

ETF（上場投資信託）は相場価格を用いて評価しております。ETF は活発な市場で取引されているため、レベル 1 の時価に分類しております。

ETF（上場投資信託）以外の投資信託は基準価額を用いて評価しております。基準価額は観察可能なインプットを用いて算出しているため、レベル 2 の時価に分類しております。

金銭の信託

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しており、レベル 2 の時価に分類しております。

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

第 37 期（2022 年 3 月 31 日現在）及び第 38 期（2023 年 3 月 31 日現在）

関連会社株式（貸借対照表計上額は 159,536 千円）は、市場価格がないため、記載しておりません。

2. その他有価証券

第 37 期 (2022 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	19,193,250	16,560,340	2,632,910
	小計	19,193,250	16,560,340	2,632,910
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	6,273,658	6,561,836	△288,177
	小計	6,273,658	6,561,836	△288,177
合計		25,466,909	23,122,176	2,344,732

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」(貸借対照表計上額は 8,401,300 千円、取得原価は 8,400,000 千円)を含めております。

非上場株式(貸借対照表計上額は 31,360 千円)は、市場価格がないため、含めておりません。

第 38 期 (2023 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	8,983,713	7,558,314	1,425,399
	小計	8,983,713	7,558,314	1,425,399
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	15,018,343	15,474,760	△456,417
	小計	15,018,343	15,474,760	△456,417
合計		24,002,056	23,033,074	968,982

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」(貸借対照表計上額は 10,400,000 千円、取得原価は 10,400,000 千円)を含めております。

3. 売却したその他有価証券

第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 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	4,164,921	605,706	28,188
合計	4,164,921	605,706	28,188

第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 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	17,240	—	14,120
債券	—	—	—
その他	1,551,405	387,113	1,708
合計	1,568,645	387,113	15,828

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について 36,558 千円（その他有価証券のその他 36,558 千円）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について 104,554 千円（その他有価証券のその他 104,554 千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ 50%以上下落した場合、及び 30%以上 50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度（積立型制度）及び退職一時金制度（非積立型制度）を設けております。また確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
退職給付債務の期首残高	3,729,235 千円	3,723,521 千円
勤務費用	198,457	196,190
利息費用	21,549	25,925
数理計算上の差異の 発生額	△46,069	△186,130
退職給付の支払額	△179,650	△176,727
過去勤務費用の発生額	—	—
退職給付債務の期末残高	3,723,521	3,582,778

（2）年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
年金資産の期首残高	2,649,846 千円	2,583,927 千円
期待運用収益	47,588	46,453
数理計算上の差異の 発生額	1,824	△103,934
事業主からの拠出額	—	—
退職給付の支払額	△115,331	△100,694
年金資産の期末残高	2,583,927	2,425,752

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

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
積立型制度の 退職給付債務	2,675,015 千円	2,468,195 千円
年金資産	△2,583,927	△2,425,752
	91,087	42,442
非積立型制度の退職給付債務	1,048,506	1,114,583
未積立退職給付債務	1,139,593	1,157,025
未認識数理計算上の差異	205,679	281,343
未認識過去勤務費用	△288,681	△223,319
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	1,056,591	1,215,049
退職給付引当金	1,246,300	1,333,882
前払年金費用	△189,708	△118,832
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	1,056,591	1,215,049

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
勤務費用	198,457 千円	196,190 千円
利息費用	21,549	25,925
期待運用収益	△47,588	△46,453
数理計算上の差異の 費用処理額	△3,547	△6,532
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	109,013	1,600
確定給付制度に係る 退職給付費用	343,245	236,091

(注)「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額及び退職金です。

(5) 年金資産に関する事項

①年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
債券	62.0 %	63.6 %
株式	36.3	34.2
その他	1.7	2.2
合計	100	100

②長期期待運用収益率の設定方法

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

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
割引率	0.078～0.72%	0.066～1.13%
長期期待運用収益率	1.5～1.8%	1.5～1.8%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度 151,370 千円、当事業年度 152,084 千円であります。

(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 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
繰延税金資産		
減損損失	410,082千円	499,742千円
投資有価証券評価損	65,490	47,876
未払事業税	165,702	169,997
賞与引当金	288,528	260,221
役員賞与引当金	25,799	29,828
役員退職慰労引当金	36,112	23,169
退職給付引当金	381,617	408,434
減価償却超過額	145,316	227,100
差入保証金	—	52,869
長期差入保証金	52,869	—
時効後支払損引当金	76,615	77,865
連結納税適用による時価評価	35,311	35,311
その他	76,257	177,003
繰延税金資産 小計	1,759,702	2,009,420
評価性引当額	—	—
繰延税金資産 合計	1,759,702	2,009,420
繰延税金負債		
前払年金費用	△58,088	△36,386
連結納税適用による時価評価	△1,149	△1,098
その他有価証券評価差額金	△717,957	△296,702
その他	△101	△101
繰延税金負債 合計	△777,296	△334,288
繰延税金資産の純額	982,406	1,675,132

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
第 37 期（2022 年 3 月 31 日現在）及び第 38 期（2023 年 3 月 31 日現在）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差が法定実効税率の 100 分の 5 以下であるため注記を省略しております。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第 42 号 2021 年 8 月 12 日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（収益認識関係）

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

収益及び契約から生じるキャッシュ・フローの性質、金額、時期及び不確実性に影響を及ぼす主要な要因に基づく区分に当該収益を分解した情報については、重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

収益を理解するための基礎となる情報は、「（重要な会計方針）の 6. 収益および費用の計上基準」に記載のとおりであります。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第 37 期（自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日）及び第 38 期（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 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 37 期（自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日）及び第 38 期（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 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]

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。

[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]

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。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

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 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 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 (注 5)	科目	期末残高 (注 5)
親会社	㈱三菱 UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税	連結納税に 伴う支払 (注 1)	4,062,765 千円	その他未払金	3,887,520 千円
親会社	三菱 UFJ 信託銀行㈱	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	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 (注 2)	5,153,589 千円	未払手数料	836,105 千円
						投資の助言	投資助言料 (注 3)	499,388 千円	未払費用	272,264 千円
						役員の兼任				

第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 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 (注 5)	科目	期末残高 (注 5)
親会社	㈱三菱 UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税等	連結納税等 に伴う支払 (注 4)	3,947,200 千円	その他未払金	77,007 千円
親会社	三菱 UFJ 信託銀行㈱	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	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 (注 2)	4,893,312 千円	未払手数料	790,279 千円
						投資の助言	投資助言料 (注 3)	463,416 千円	未払費用	253,093 千円
						役員の兼任				

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1. 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。
2. 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。
3. 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。
4. 連結納税制度及びグループ通算制度に基づく法人税の支払予定額であります。
5. 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 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 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 (注 2)	科目	期末残高 (注 2)
同一の親会社を持つ会社	㈱三菱 UFJ 銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	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 (注 1)	4,097,951 千円	未払手数料	838,058 千円
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 (注 1)	7,025,984 千円	未払手数料	1,319,958 千円

第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 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 (注 2)	科目	期末残高 (注 2)
同一の親会社を持つ会社	㈱三菱 UFJ 銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	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 (注 1)	4,052,979 千円	未払手数料	868,785 千円
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 (注 1)	6,661,991 千円	未払手数料	1,218,051 千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 1. 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。

2. 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、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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	400,322.84 円	415,979.76 円
1株当たり当期純利益金額	57,424.97 円	48,881.17 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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益金額（千円）	12,150,032	10,342,327
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）	12,150,032	10,342,327
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581	211,581

中間財務諸表
(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第 39 期中間会計期間 (2023 年 9 月 30 日現在)		
(資産の部)		
流動資産		
現金及び預金		49,727,641
有価証券		1,621,227
前払費用		710,443
未収入金		93,528
未収委託者報酬		19,282,859
未収収益		770,875
金銭の信託		10,401,000
その他		740,886
流動資産合計		83,348,451
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1	2,546,133
器具備品	※1	1,676,631
土地		628,433
建設仮勘定		10,560
有形固定資産合計		4,861,758
無形固定資産		
電話加入権		15,822
ソフトウェア		4,917,655
ソフトウェア仮勘定		1,357,259
無形固定資産合計		6,290,737
投資その他の資産		
投資有価証券		14,016,994
関係会社株式		159,536
投資不動産	※1	1,580,210
長期差入保証金		689,627
前払年金費用		83,203
繰延税金資産		1,274,071
その他		45,230
貸倒引当金		△23,600
投資その他の資産合計		17,825,273
固定資産合計		28,977,769
資産合計		112,326,220

(単位：千円)

第 39 期中間会計期間
(2023 年 9 月 30 日現在)

(負債の部)

流動負債

預り金	492,861
未払金	
未払収益分配金	105,556
未払償還金	44,768
未払手数料	6,929,093
その他未払金	3,313,588
未払費用	6,935,916
未払消費税等	※2 319,737
未払法人税等	2,205,065
賞与引当金	899,167
役員賞与引当金	78,660
その他	5,517
流動負債合計	21,329,934

固定負債

退職給付引当金	1,375,952
役員退職慰労引当金	32,510
時効後支払損引当金	252,955
資産除去債務	704,072
固定負債合計	2,365,490

負債合計

23,695,424

(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	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712

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	33,502,194
利益剰余金合計	40,842,784

株主資本合計

87,575,628

(単位：千円)

第 39 期中間会計期間
(2023 年 9 月 30 日現在)

評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,055,167
評価・換算差額等合計	1,055,167
純資産合計	88,630,795
負債純資産合計	112,326,220

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

第 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)	
営業収益	
委託者報酬	47,550,495
投資顧問料	1,407,644
その他営業収益	10,158
営業収益合計	48,968,298
営業費用	
支払手数料	16,737,084
広告宣伝費	208,241
公告費	892
調査費	
調査費	1,594,100
委託調査費	12,907,263
事務委託費	947,553
営業雑経費	
通信費	53,048
印刷費	194,402
協会費	33,149
諸会費	9,640
事務機器関連費	1,212,110
その他営業雑経費	5,384
営業費用合計	33,902,872
一般管理費	
給料	
役員報酬	190,163
給料・手当	2,957,056
賞与引当金繰入	899,167
役員賞与引当金繰入	78,660
福利厚生費	645,394
交際費	4,144
旅費交通費	46,547
租税公課	204,887
不動産賃借料	390,491
退職給付費用	188,933
固定資産減価償却費	※1 1,169,259
諸経費	275,931
一般管理費合計	7,050,636
営業利益	8,014,788

(単位：千円)

第 39 期中間会計期間

(自 2023 年 4 月 1 日
至 2023 年 9 月 30 日)

営業外収益	
受取配当金	27,966
受取利息	6,353
投資有価証券償還益	19,971
収益分配金等時効完成分	15,896
受取賃貸料	36,751
その他	20,823
営業外収益合計	127,762
営業外費用	
投資有価証券償却損	53,716
時効後支払損引当金繰入	1,347
事務過誤費	10,736
賃貸関連費用	※1 16,188
その他	3,902
営業外費用合計	85,890
経常利益	8,056,659
特別利益	
投資有価証券売却益	132,206
固定資産売却益	1,021
特別利益合計	133,228
特別損失	
投資有価証券売却損	30,309
投資有価証券評価損	28,130
固定資産除却損	20,162
固定資産売却損	65,427
その他特別損失	289,389
特別損失合計	433,419
税引前中間純利益	7,756,468
法人税、住民税及び事業税	2,118,856
法人税等調整額	232,077
法人税等合計	2,350,934
中間純利益	5,405,533

(3) 中間株主資本等変動計算書

第 39 期中間会計期間（自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日）

（単位：千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
当中間期変動額				
剰余金の配当				
中間純利益				
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)				
当中間期変動額合計	—	—	—	—
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712

	利益剰余金				株主資本合計
	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
別途 積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	342, 589	6, 998, 000	33, 267, 700	40, 608, 289	87, 341, 133
当中間期変動額					
剰余金の配当			△5, 171, 039	△5, 171, 039	△5, 171, 039
中間純利益			5, 405, 533	5, 405, 533	5, 405, 533
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)					
当中間期変動額合計	—	—	234, 494	234, 494	234, 494
当中間期末残高	342, 589	6, 998, 000	33, 502, 194	40, 842, 784	87, 575, 628

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	672,279	672,279	88,013,413
当中間期変動額			
剰余金の配当			△5,171,039
中間純利益			5,405,533
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	382,887	382,887	382,887
当中間期変動額合計	382,887	382,887	617,382
当中間期末残高	1,055,167	1,055,167	88,630,795

〔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
市場価格のない株式等以外のもの
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。
市場価格のない株式等
移動平均法による原価法を採用しております。
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法
時価法を採用しております。
3. 固定資産の減価償却の方法
 - (1) 有形固定資産及び投資不動産
定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。
なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	5年～50年
器具備品	2年～20年
投資不動産	3年～50年
 - (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。
4. 引当金の計上基準
 - (1) 貸倒引当金
貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。
 - (2) 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。
 - (3) 役員賞与引当金
役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。
 - (4) 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。
 - ① 退職給付見込額の期間帰属方法
退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。
 - ② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法
過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により費用処理することとしております。
数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(主として10年)による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。
 - (5) 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。
 - (6) 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. 収益および費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主要な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1) 委託者報酬

投資信託の信託約款に基づき信託財産の運用指図等を行っております。委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を投資信託によって主に年2回受領しております。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2) 投資顧問料

顧客との投資一任及び投資助言契約に基づき運用及び助言を行っております。投資顧問料は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を主に年4回受領しております。当該報酬は契約期間にわたり収益として認識しております。

6. 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。

7. その他中間財務諸表作成のための重要な事項

グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

※1 減価償却累計額

第 39 期中間会計期間 (2023 年 9 月 30 日現在)	
建物	407,329 千円
器具備品	1,336,738 千円
投資不動産	170,993 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 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)	
有形固定資産	225,710 千円
無形固定資産	943,548 千円
投資不動産	7,015 千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 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	211,581	—	—	211,581
合計	211,581	—	—	211,581

2. 配当に関する事項

2023 年 6 月 28 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。

- | | |
|-------------|-----------------|
| ① 配当金の総額 | 5,171,039 千円 |
| ② 配当の原資 | 利益剰余金 |
| ③ 1 株当たり配当額 | 24,440 円 |
| ④ 基準日 | 2023 年 3 月 31 日 |
| ⑤ 効力発生日 | 2023 年 6 月 29 日 |

(リース取引関係)

第 39 期中間会計期間(2023 年 9 月 30 日現在)

〈借主側〉

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

1 年内	740,363 千円
1 年超	1,192,121 千円
合 計	1,932,485 千円

(金融商品関係)

第 39 期中間会計期間(2023 年 9 月 30 日現在)

1. 金融商品の時価等に関する事項

2023 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、市場価格のない株式等は、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) 有価証券	1,621,227	1,621,227	—
(2) 金銭の信託	10,401,000	10,401,000	—
(3) 投資有価証券	14,016,994	14,016,994	—
資産計	26,039,221	26,039,221	

(注 1) 「現金及び預金」、「未収委託者報酬」、「未払手数料」については短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注 2) 市場価格のない株式等

関連会社株式（中間貸借対照表計上額 159,536 千円）は、市場価格がないため、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もあります。

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の 3 つのレベルに分類しております。

レベル 1 の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル 2 の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル 1 のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル 3 の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産

区分	時価（千円）			
	レベル 1	レベル 2	レベル 3	合計
有価証券	—	1,621,227	—	1,621,227
金銭の信託	—	10,401,000	—	10,401,000
投資有価証券	2,257,164	11,759,829	—	14,016,994
資産計	2,257,164	23,782,057	—	26,039,221

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

ETF（上場投資信託）は相場価格を用いて評価しております。ETF は活発な市場で取引されているため、レベル 1 の時価に分類しております。

ETF（上場投資信託）以外の投資信託は基準価額を用いて評価しております。基準価額は観察可能なインプットを用いて算出しているため、レベル 2 の時価に分類しております。

金銭の信託

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しており、レベル 2 の時価に分類しております。

(有価証券関係)

第 39 期中間会計期間（2023 年 9 月 30 日現在）

1. 子会社及び関連会社株式

関連会社株式（中間貸借対照表計上額 159,536 千円）は、市場価格がないため、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	15,250,611	13,190,791	2,059,819
	小 計	15,250,611	13,190,791	2,059,819
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	10,788,610	11,327,577	△538,966
	小 計	10,788,610	11,327,577	△538,966
合 計		26,039,221	24,518,369	1,520,852

(注)「その他」には、中間貸借対照表の「金銭の信託」（中間貸借対照表計上額 10,401,000 千円、取得価額 10,400,000 千円）を含めております。

3. 減損処理を行った有価証券

当中間会計期間において、有価証券について 28,130 千円（その他有価証券のその他 28,130 千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、中間期末における時価が取得原価に比べ 50%以上下落した場合、及び 30%以上 50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの
当該資産除去債務の総額の増減

第 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)	
期首残高	—
有形固定資産の取得に伴う増加	704,072 千円
時の経過による調整額	—
中間期末残高	704,072 千円

(収益認識関係)

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

収益及び契約から生じるキャッシュ・フローの性質、金額、時期及び不確実性に影響を及ぼす主要な要因に基づく区分に当該収益を分解した情報については、重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第 39 期中間会計期間（自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 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 39 期中間会計期間（自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 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。

(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 39 期中間会計期間 (2023 年 9 月 30 日現在)
1 株当たり純資産額	418,897.70 円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額 (千円)	88,630,795
普通株式に係る中間期末の純資産額 (千円)	88,630,795
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)	211,581

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 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)
1 株当たり中間純利益金額	25,548.29 円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額 (千円)	5,405,533
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)	5,405,533
普通株式の期中平均株式数 (株)	211,581

(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。

(重要な後発事象)

共通支配下の取引等

当社は 2023 年 7 月 31 日開催の取締役会において、三菱UFJ 不動産投資顧問株式会社(旧商号：MU 投資顧問株式会社)と吸収分割契約を締結することを決議し、同日、吸収分割の効力発生日を 2023 年 10 月 1 日とする吸収分割契約を締結いたしました。本吸収分割契約に基づき、当社と三菱UFJ 不動産投資顧問株式会社は、2023 年 10 月 1 日付で吸収分割を実施いたしました。

なお、2023 年 10 月 1 日付で当社は「三菱UFJ アセットマネジメント株式会社」へ商号変更しました。

(1) 取引の概要

①被取得企業の名称及びその事業の内容

被取得企業の名称 三菱UFJ 不動産投資顧問株式会社

事業の内容 投資顧問業、私募投資信託の設定・運用等

②企業結合日

2023 年 10 月 1 日

③企業結合の法的形式

当社と兄弟会社である三菱UFJ 不動産投資顧問株式会社を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする無対価吸収分割

④結合後企業の名称

分割会社：三菱UFJ 不動産投資顧問株式会社

承継会社：三菱UFJ アセットマネジメント株式会社

⑤企業結合を行う主な理由

法人投資家の運用ニーズが拡大しており、両社で取り組みを強化している法人投資家ビジネスにかかる運用・営業等の関連機能を三菱UFJ アセットマネジメント株式会社に統合することで、リソースやノウハウの集約を通じた運用機能等の強化を図ってまいります。

(2) 実施する会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準（企業会計基準第 21 号 2019 年 1 月 16 日）」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針（企業会計基準適用指針第 10 号 2019 年 1 月 16 日）」に基づき、共通支配下の取引として処理する予定です。

4 【利害関係人との取引制限】

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

- ①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。）。
- ②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。）。
- ③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④⑤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。
- ④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。
- ⑤上記③④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】

①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。

②訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

約款

追加型証券投資信託

海外債券セレクション（ラップ向け）

約 款

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

海外債券セレクション（ラップ向け）

運用の基本方針

約款第19条の規定に基づき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、主として利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざして運用を行います。

2. 運用方法

（1）投資対象

投資信託証券を主要投資対象とします。

（2）投資態度

- ①投資信託証券への投資を通じて、主として海外債券に実質的な投資を行います。
- ②投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。
また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。
- ③投資信託証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。
- ④実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ⑤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。

（3）投資制限

- ①株式への直接投資は行いません。
- ②投資信託証券への投資割合に制限を設けません。
- ③外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
- ④外国為替予約取引は為替変動リスクを回避するため行うことができます。

3. 収益分配方針

毎計算期末に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

- ①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。
- ②収益分配金額は、委託者が基準価額水準、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。
- ③収益の分配にあてなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

追加型証券投資信託
『海外債券セレクション（ラップ向け）』約款

（信託の種類、委託者および受託者）

第1条 この信託は、証券投資信託であり、三菱UFJアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者とします。

② この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

（信託事務の委託）

第2条 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本条、第18条第1項および第2項ならびに第23条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

② 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

（信託の目的および金額）

第3条 委託者は、金1,000万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

（信託金の限度額）

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

（信託期間）

第5条 この信託の期間は、信託契約締結日から2027年2月5日まで、または第39条第8項、第40条第1項、第41条第1項、第42条第1項および第44条第2項の規定による信託期間終了日までとします。

（受益権の取得申込みの勧誘の種類）

第6条 この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

（当初の受益者）

第7条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第8条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

（受益権の分割および再分割）

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権については1,000万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

（追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法）

第9条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託に係る受益権の口数を乗じて得た額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第20条に規定する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て得た金額（以下「純資産総額」といいます。）を計算日における受益権総

口数で除して得た金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、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って計算します。

- ③ 第22条に規定する予約為替の評価は、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るものとします。

（信託日時の異なる受益権の内容）

第10条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第11条 この信託のすべての受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ② 委託者は、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、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者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。

- ③ 委託者は、第8条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

（受益権の設定に係る受託者の通知）

第12条 受託者は、第3条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

（受益権の申込単位および価額）

第13条 委託者の指定する第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。）および登録金融機関（金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第8条第1項の規定により分割される受益権について、その取得申込者に対し、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の定める単位をもって取得申込みに応じることができます。ただし、取得申込者が委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関と別に定める累積投資契約約款に基づく契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結している場合に限り、1口の整数倍をもって取得申込みに応じることができます。

- ② 委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、別に定める日には、前項による受益権の取得申込みに応じないものとします。

- ③ 委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）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（投資対象証券の取得の制限、投資対象国・地域における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、第1項による

受益権の取得申込みの受付けを中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受付けを取り消すことができます。

- ④ 委託者は、前2項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の追加信託金の申込みについては、これを受け付けるものとします。
- ⑤ 第1項の場合の受益権の価額は、取得申込みを受け付けた日の翌々営業日の基準価額に、手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、取得日が信託契約締結日である場合の受益権の価額は、1口につき1円とします。
- ⑥ 前項の手数料の額は、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関がそれぞれ定めるものとします。
- ⑦ 第5項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、第31条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑧ 第1項の取得申込者は委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該取得申込みの代金（第5項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

（受益権の譲渡に係る記載または記録）

第14条 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。

- ② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項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。
- ③ 委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者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。

（受益権の譲渡の対抗要件）

第15条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

（投資の対象とする資産の種類等）

第16条 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. 約束手形
 - ハ. 金銭債権
 - 2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形
- ② 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該

比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(投資の対象とする有価証券等)

第17条 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、別に定める投資信託証券（投資信託および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。）ならびに投資証券および外国投資証券（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。）をいいます。以下同じ。）のほか、次に掲げるものとします。

1. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（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の新株引受権証券を除きます。）
2. コマーシャル・ペーパー
3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券の性質を有するもの
4. 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。）

なお、第1号の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は短期社債等への投資ならびに買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができます。

- ② 委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（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。）により運用することを指図することができます。

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

(利害関係人等との取引等)

第18条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となつて行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第23条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第16条第1項および前条に掲げる資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

- ② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

- ③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条第1項および前条に掲げる資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

- ④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

(運用の基本方針)

第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

(公社債の借入れ)

第20条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

② 前項の指図は、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。

③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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。

④ 第1項の借入れに係る品借料は、信託財産中から支弁します。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第21条 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。

(外国為替予約取引の指図)

第22条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、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。

(信託業務の委託等)

第23条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと

2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること

3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること

4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

1. 信託財産の保存に係る業務

2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務

3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務

4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

(混蔵寄託)

第24条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこれに類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行されたコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できます。

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第25条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保する

ことがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

（有価証券売却等の指図）

第26条 委託者は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第27条 委託者は、前条の規定による売却代金、有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

（資金の借入れ）

第28条 委託者は、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。

- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

（損益の帰属）

第29条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

（受託者による資金立替え）

第30条 信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

（信託の計算期間）

第31条 この信託の計算期間は、毎年2月6日から翌年2月5日までとすることを原則とします。

- ② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は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、第1計算期間は信託契約締結日から2018年2月5日までとし、最終計算期間の終了日は第5条に規定するこの信託の信託期間の終了日とします。

（信託財産に関する報告等）

第32条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③ 受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。

④ 受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

⑤ 受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできないものとします。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所

2. 他の受益者が有する受益権の内容

(信託事務の諸費用および監査報酬)

第33条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

② 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に相当する金額は、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信託財産中から支弁します。

(信託報酬等)

第34条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の38の率を乗じて得た額とします。

② 前項の信託報酬は、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信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

③ 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

(収益の分配)

第35条 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（「配当等収益」といいます。）は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責)

第36条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除して得た額をいいます。以下同じ。）については第37条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第39条第3項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）については第37条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および

一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責を負わないものとします。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第37条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に支払います。

② 前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関に交付されます。この場合、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該収益分配金をこの信託の受益権の取得申込金として、受益者毎に当該収益分配金の再投資に係る受益権の取得申込みに応じたものとしします。当該取得申込みに応じることにより増加した受益権は第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

③ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

④ 一部解約金は、第39条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、7営業日目から当該受益者に支払います。

⑤ 前各項（第2項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の営業所等において行うものとしします。

⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとしします。

(収益分配金および償還金の時効)

第38条 受益者が、収益分配金については前条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(信託契約の一部解約)

第39条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関が定める単位をもって、委託者に一部解約の実行を請求することができます。

② 委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

- ③ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求を受け付けた日の翌々営業日の基準価額とします。
- ④ 受益者が第1項の一部解約の実行の請求をするときは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ⑤ 委託者は別に定める日には、第1項に規定する一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
- ⑥ 委託者は、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（投資対象証券の換金の制限、投資対象国・地域における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことができます。
- ⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、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一部解約の実行の請求を受け付けたものとして第3項の規定に準じて計算された価額とします。
- ⑧ 委託者は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ⑨ 委託者は、前項の規定に基づいてこの信託契約を解約しようとするときは、第40条第2項から第5項の規定にしたがいます。

（信託契約の解約）

第40条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができるものとし、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「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信託契約の解約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、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）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、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④ 第2項の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ⑤ 第2項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第2項から前項までの手続を行うことが困難な場合も同じく適用しません。

（信託契約に関する監督官庁の命令）

第41条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第45条

の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第42条 委託者が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第45条第2項に規定する書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第43条 委託者は、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。

- ② 委託者は、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。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第44条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者が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、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第45条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更等)

第45条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

- ② 委託者は、前項の変更または併合（変更にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。）をしようとする場合には、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更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、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- ④ 第2項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

- ⑤ 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

- ⑥ 第2項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

- ⑦ 前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合に係る一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否

決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

(反対者の買取請求権)

第46条 第40条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託者に対し、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。

② 前項の規定は、受益者が自己に帰属する受益権についてその全部または一部の償還を請求したときに、委託者が第39条の規定に基づいて信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じることとする場合には適用しません。

(信託期間の延長)

第47条 委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託者と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第48条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、当該運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

(公告)

第49条 委託者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。

<https://www.am.mufg.jp/>

② 前項の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。

(質権口記載または記録の受益権の取扱い)

第50条 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、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第51条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(附則)

第1条 この約款において「累積投資契約」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関が締結する「累積投資契約」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「累積投資契約」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第37条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

信託契約締結日 2017年3月27日

(付表)

1. 約款第13条第2項および第39条第5項に規定する「別に定める日」とは、次のものをいいます。

ニューヨーク証券取引所の休業日の前営業日

ニューヨークの銀行の休業日の前営業日

ロンドン証券取引所の休業日の前営業日

ロンドンの銀行の休業日の前営業日

2. 約款第17条第1項に規定する「別に定める投資信託証券」とは、海外債券に実質的な投資を行う次に掲げる投資信託証券をいいます。

親投資信託 外国債券インデックスマザーファンド

親投資信託 海外債券マザーファンド

親投資信託 新興国債券インデックスマザーファンド

追加型証券投資信託 グローバル社債ファンド T (適格機関投資家専用)

