

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年5月6日提出
【計算期間】	第5期(自 2021年2月6日至 2022年2月7日)
【ファンド名】	海外債券セレクション（ラップ向け）
【発行者名】	三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 横川 直
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目１２番１号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【連絡場所】	東京都千代田区有楽町一丁目１２番１号
【電話番号】	03-6250-4740
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、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		
追加型	海外	不動産投信	MR F	特殊型 ()
	内外	その他資産 ()		
		資産複合	E T F	

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式 一般 大型株 中小型株	年１回	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
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ()	年２回 年４回 年６回 (隔月) 年１２回 (毎月) 日々 その他 ()	日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX その他 ()	条件付運用型 ロング・ ショート型／ 絶対収益 追求型 その他 ()
不動産投信						
その他資産 (投資信託証券 (債券 一般))						
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「MMF等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「MMF等の運営に関する規則」に規定するMR Fをいいます。
	E T F	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	特殊型	信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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

属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。

	公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（BBB格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（BB格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。
	決算頻度	
	年1回	信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年2回	信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	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。
	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。
投資形態	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。
	ファミリーファンド	信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。

	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第２条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対 象 イ ン デックス	日経２２５	信託約款において、日経２２５に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	ＴＯＰＩＸ	信託約款において、ＴＯＰＩＸに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型／絶対収益追求型	信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

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

特色

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。

- 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、2022年5月7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。

<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）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。

- ・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。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。
- ・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 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。

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

特色2

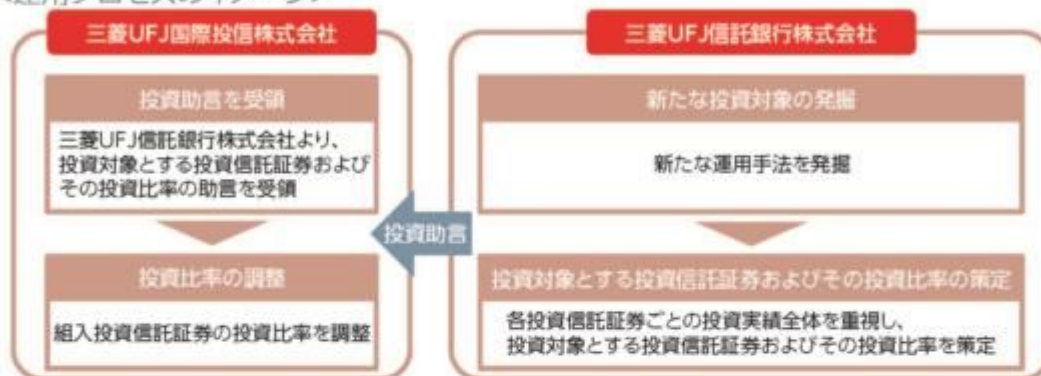
三菱UFJ信託銀行からの投資助言に基づき運用を行います。

- 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。

① 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。

② 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>



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。

👉 「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(<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)でご覧いただけます。

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。



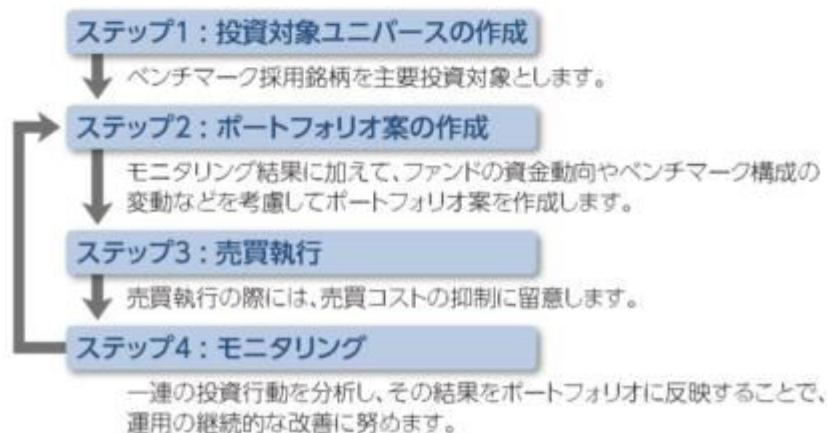
- 1 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。
- 2 上記の投資対象とする投資信託証券(および投資対象とする投資信託証券が投資するマザーファンドを含む)は、2022年5月7日現在のものであり、今後変更される場合があります。

■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

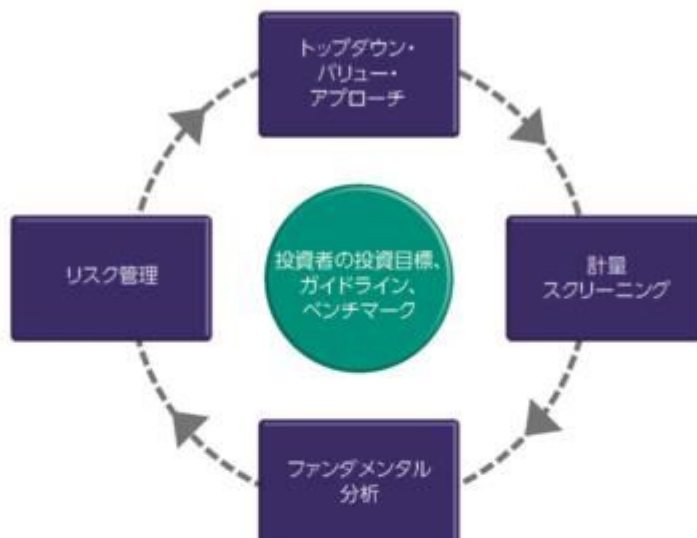
<外国債券インデックスマザーファンド／新興国債券インデックスマザーファンド>



- 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。

<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)・データに基づき当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、指数構成国のウエ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。

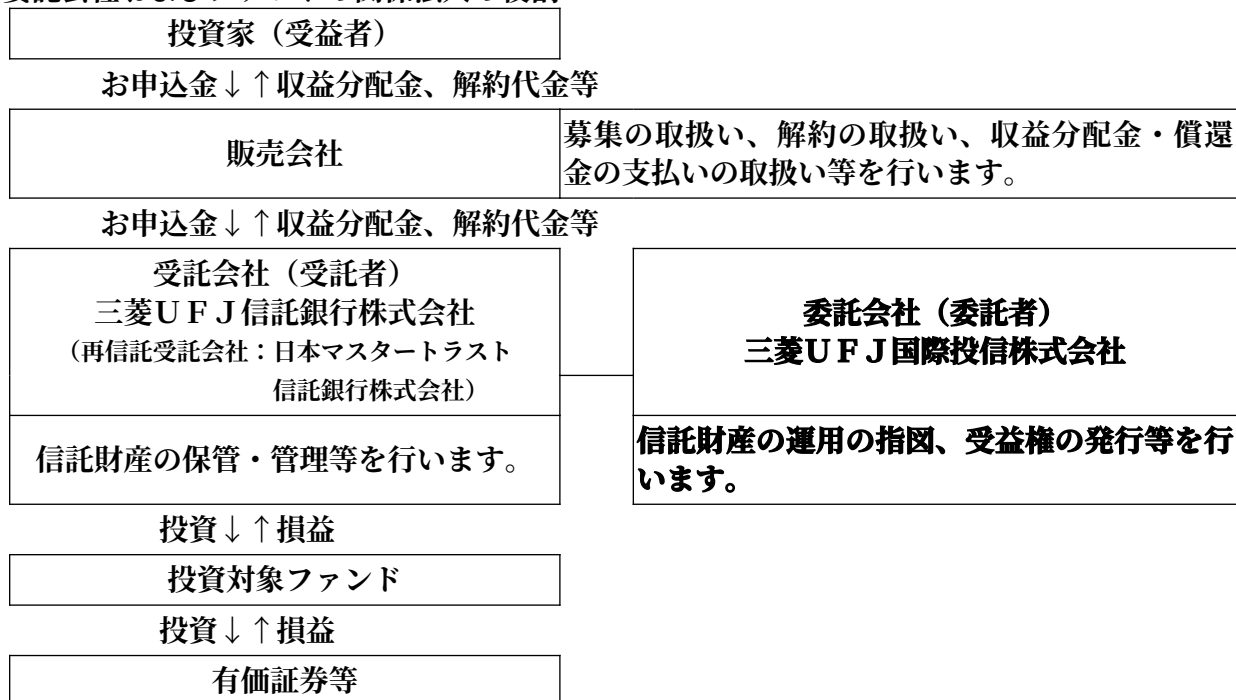
(2) 【ファンドの沿革】

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（2022年2月末現在）

- 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
- 大株主の状況

株主名	住所	所有株式数	所有比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	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す。）

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

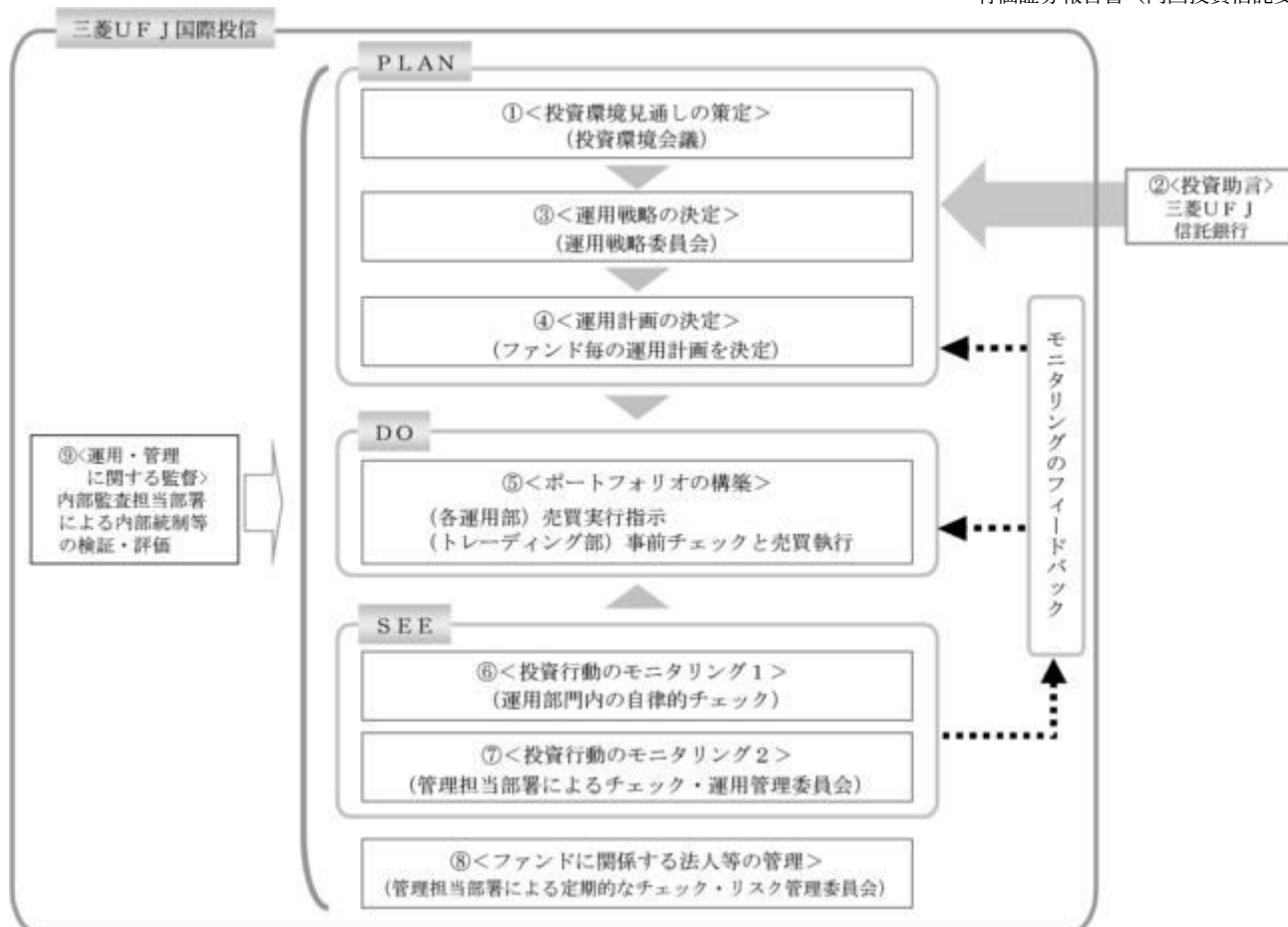
外国債券インデックスマザーファンド	
形態	証券投資信託
投資態度	・主として対象インデックスに採用されている国債に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。 ・投資成果を対象インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。 ・公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、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	・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国際投信株式会社
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。

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	・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。 ・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	・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。 ・金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡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国際投信株式会社
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	・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	・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	・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	・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投資行動のモニタリング1

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

⑦投資行動のモニタリング2

運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

⑧ファンドに係る法人等の管理

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

⑨運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（10名程度）は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健

全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

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、委託会社に関する「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性が生じた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の方が小さかった場合も同様です。

収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。

（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、運用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審議しています。

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。運用管理委員会は、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トレーディング担当部署

有価証券等の売買執行および発注に係る法令等の遵守および監視・牽制を行います。

②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、法令等遵守状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

③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。

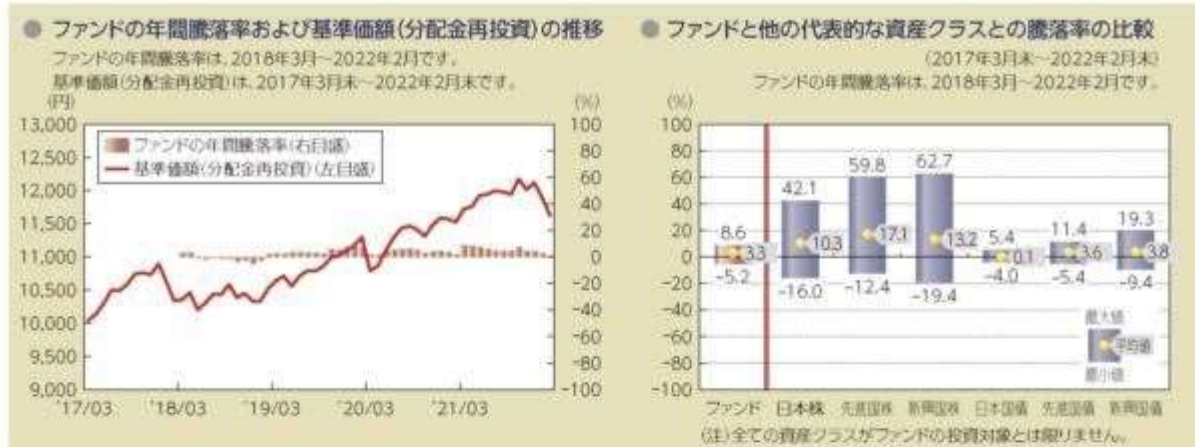
④内部監査担当部署

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、野村證券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。当該指数の著作権は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（2022年５月７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	—
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・配当金に限ります。）との損益通算が可能となる仕組みがあります。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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2022年2月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

【海外債券セレクション（ラップ向け）】

（１）【投資状況】

令和 4年 2月28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	4,521,989,525	32.89
親投資信託受益証券	日本	8,943,995,481	65.05
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	284,031,310	2.06
純資産総額		13,750,016,316	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

令和 4年 2月28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	3,755,870,372	2.2803	8,564,561,346	2.2489	8,446,576,879	61.43

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）	3,659,455,795	1.2738	4,661,556,147	1.2357	4,521,989,525	32.89
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	355,629,229	1.4306	508,763,176	1.3987	497,418,602	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

令和 4年 2月28日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	32.89
親投資信託受益証券	65.05
合計	97.93

（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令和4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	(平成30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	(平成31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	(令和 2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	(令和 3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	(令和 4年 2月 7日)	14,001,523,663	14,001,523,663	11,855	11,855
	令和 3年 2月末日	8,364,453,186	—	11,530	—
	3月末日	8,881,740,863	—	11,722	—
	4月末日	9,328,939,215	—	11,758	—
	5月末日	10,735,929,775	—	11,924	—
	6月末日	11,416,333,352	—	11,945	—
	7月末日	11,950,747,903	—	11,997	—
	8月末日	12,467,794,909	—	11,981	—

9月末日	12,743,967,546	—	11,941	—
10月末日	13,331,777,977	—	12,174	—
11月末日	13,535,681,565	—	12,014	—
12月末日	14,078,681,149	—	12,119	—
令和 4年 1月末日	14,042,362,096	—	11,890	—
2月末日	13,750,016,316	—	11,625	—

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

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

（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

（参考）

外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

令和 4年 2月28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	139,247,560,733	47.73
	フランス	26,750,814,177	9.17
	イタリア	24,825,987,103	8.51
	ドイツ	19,615,538,294	6.72
	スペイン	17,189,229,331	5.89
	イギリス	16,531,646,156	5.67
	ベルギー	6,210,634,861	2.13
	カナダ	5,776,405,653	1.98
	オランダ	5,009,173,932	1.72
	オーストラリア	4,483,341,865	1.54
	オーストリア	3,837,308,497	1.32
	中国	2,669,886,910	0.92
	アイルランド	2,134,545,730	0.73
	メキシコ	2,079,870,098	0.71
	フィンランド	1,572,920,244	0.54
	マレーシア	1,485,395,210	0.51
	イスラエル	1,248,670,550	0.43
	デンマーク	1,232,608,642	0.42
	シンガポール	1,231,621,122	0.42
	ポーランド	1,227,448,709	0.42
	スウェーデン	769,292,419	0.26
	ノルウェー	682,348,180	0.23
	小計	285,812,248,416	97.98
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	5,905,362,191	2.02
純資産総額		291,717,610,607	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

令和 4年 2月28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	0.75 T-NOTE 260331	15,950,000	11,526.79	1,838,524,357	11,041.34	1,761,094,390	0.750000	2026/3/31	0.60
アメリカ	国債証券	3.375 T-BOND 481115	12,530,000	14,763.40	1,849,854,983	13,934.60	1,746,006,357	3.375000	2048/11/15	0.60
アメリカ	国債証券	3 T-BOND 480815	12,960,000	13,767.72	1,784,297,239	13,013.81	1,686,590,910	3.000000	2048/8/15	0.58
アメリカ	国債証券	3.75 T-BOND 410815	11,510,000	15,107.66	1,738,891,949	14,059.18	1,618,212,211	3.750000	2041/8/15	0.55
フランス	国債証券	1.75 O.A.T 241125	11,320,000	13,815.34	1,563,897,389	13,628.05	1,542,695,416	1.750000	2024/11/25	0.53
アメリカ	国債証券	1.75 T-NOTE 241231	13,350,000	11,680.94	1,559,406,758	11,555.00	1,542,592,500	1.750000	2024/12/31	0.53
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 310515	13,750,000	11,815.86	1,624,681,372	11,209.25	1,541,272,250	1.625000	2031/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 231115	13,040,000	12,233.03	1,595,187,839	11,794.22	1,537,966,889	2.750000	2023/11/15	0.53
アメリカ	国債証券	0.875 T-NOTE 301115	14,480,000	10,874.13	1,574,574,908	10,543.48	1,526,696,790	0.875000	2030/11/15	0.52
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280515	12,490,000	12,804.13	1,599,236,016	12,172.01	1,520,285,165	2.875000	2028/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280815	11,510,000	12,798.96	1,473,161,144	12,190.52	1,403,129,427	2.875000	2028/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	2.375 T-BOND 510515	11,720,000	12,646.68	1,482,191,275	11,725.61	1,374,242,287	2.375000	2051/5/15	0.47
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 240531	11,730,000	12,067.79	1,415,552,576	11,642.56	1,365,672,901	2.000000	2024/5/31	0.47
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 280430	12,200,000	11,508.78	1,404,071,160	11,085.12	1,352,385,464	1.250000	2028/4/30	0.46
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 260515	11,770,000	11,994.09	1,411,704,393	11,430.42	1,345,360,746	1.625000	2026/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 280215	10,640,000	12,685.81	1,349,770,496	12,075.87	1,284,873,391	2.750000	2028/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300815	12,260,000	10,646.20	1,305,224,174	10,342.17	1,267,950,822	0.625000	2030/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	3.125 T-NOTE 281115	9,940,000	13,011.65	1,293,358,587	12,390.02	1,231,568,912	3.125000	2028/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 310815	11,130,000	11,173.60	1,243,622,635	10,822.43	1,204,536,573	1.250000	2031/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 311115	11,000,000	11,401.75	1,254,192,855	10,928.05	1,202,085,605	1.375000	2031/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 230930	10,150,000	12,236.09	1,241,963,820	11,814.08	1,199,129,604	2.875000	2023/9/30	0.41
アメリカ	国債証券	2.125 T-NOTE 240331	10,160,000	12,121.36	1,231,531,033	11,675.51	1,186,232,326	2.125000	2024/3/31	0.41
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 261115	10,100,000	12,037.99	1,215,837,899	11,610.51	1,172,662,333	2.000000	2026/11/15	0.40
ドイツ	国債証券	0 OBL 241018	8,900,000	13,107.97	1,166,609,743	13,040.77	1,160,628,544	0.000000	2024/10/18	0.40
スペイン	国債証券	0 SPAIN GOVT 250131	8,930,000	13,117.33	1,171,378,314	12,887.03	1,150,812,373	0.000000	2025/1/31	0.39
アメリカ	国債証券	0.125 T-NOTE 230430	10,000,000	11,426.16	1,142,616,175	11,402.43	1,140,243,789	0.125000	2023/4/30	0.39
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 270815	9,690,000	12,333.42	1,195,108,551	11,756.30	1,139,186,415	2.250000	2027/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	0.125 T-NOTE 230630	10,000,000	11,397.15	1,139,715,870	11,368.13	1,136,813,398	0.125000	2023/6/30	0.39
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 290815	10,020,000	11,749.45	1,177,295,547	11,294.56	1,131,715,024	1.625000	2029/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 310215	10,470,000	11,162.46	1,168,709,594	10,751.11	1,125,641,744	1.125000	2031/2/15	0.39

（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

令和 4年 2月28日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.98
合計	97.98

（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

令和 4年 2月28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	中国	5,224,495,743	10.09
	インドネシア	5,192,111,740	10.03
	タイ	4,848,486,311	9.36
	メキシコ	4,729,482,187	9.13
	マレーシア	4,449,463,707	8.59
	ブラジル	4,444,398,568	8.58
	南アフリカ	4,319,740,067	8.34
	ポーランド	3,518,809,553	6.79
	ロシア	2,498,737,404	4.82
	チェコ	2,395,643,830	4.63
	コロンビア	2,042,504,227	3.94
	ハンガリー	1,698,102,959	3.28
	ルーマニア	1,550,996,314	2.99
	ペルー	1,161,058,628	2.24
	チリ	1,076,635,792	2.08
	トルコ	441,040,056	0.85
	エジプト	422,302,612	0.82
	セルビア	150,896,052	0.29
	ウルグアイ	65,776,009	0.13
	ドミニカ共和国	53,215,884	0.10
	フィリピン	49,054,360	0.09
小計		50,332,952,003	97.19

コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	1,456,966,004	2.81
純資産総額		51,789,918,007	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

令和 4年 2月28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 240101	59,300,000	1,818.96	1,078,643,465	1,821.98	1,080,436,341	—	2024/1/1	2.09
ブラジル	国債証券	BRAZIL-LTN 230701	53,900,000	1,912.11	1,030,628,610	1,917.49	1,033,527,712	—	2023/7/1	2.00
南アフリ カ	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	89,200,000	832.03	742,173,346	832.43	742,535,088	10.500000	2026/12/21	1.43
チェコ	国債証券	0.25 CZECH REPUBL 270210	147,500,000	445.68	657,389,493	448.94	662,192,324	0.250000	2027/2/10	1.28
チェコ	国債証券	0.05 CZECH REPUBL 291129	151,000,000	406.55	613,895,144	411.98	622,098,571	0.050000	2029/11/29	1.20
メキシコ	国債証券	5.75 MEXICAN BONO 260305	119,200,000	528.36	629,815,180	521.78	621,973,518	5.750000	2026/3/5	1.20
ブラジル	国債証券	10 (IN)BRAZIL NT 270101	28,270,000	2,165.48	612,183,949	2,177.65	615,623,929	10.000000	2027/1/1	1.19
南アフリ カ	国債証券	8 SOUTH AFRICA 300131	84,200,000	694.52	584,789,882	699.10	588,647,168	8.000000	2030/1/31	1.14
マレーシ ア	国債証券	3.955 MALAYSIAGOV 250915	20,500,000	2,839.41	582,080,086	2,834.55	581,082,939	3.955000	2025/9/15	1.12
南アフリ カ	国債証券	8.75 SOUTH AFRICA 480228	87,700,000	632.87	555,028,430	640.34	561,578,312	8.750000	2048/2/28	1.08
メキシコ	国債証券	7.5 MEXICAN BONOS 270603	97,200,000	562.48	546,738,502	553.83	538,324,221	7.500000	2027/6/3	1.04
メキシコ	国債証券	8 MEXICAN BONOS 240905	92,000,000	570.24	524,622,346	564.32	519,179,659	8.000000	2024/9/5	1.00
メキシコ	国債証券	7.75 MEXICAN BONO 310529	83,300,000	566.34	471,768,108	555.71	462,908,943	7.750000	2031/5/29	0.89
マレーシ ア	国債証券	3.885 MALAYSIAGOV 290815	16,050,000	2,798.48	449,156,822	2,789.00	447,634,772	3.885000	2029/8/15	0.86
インドネ シア	国債証券	6.5 INDONESIA 250615	52,400,000,000	0.84	445,237,560	0.84	445,131,450	6.500000	2025/6/15	0.86
南アフリ カ	国債証券	8.25 SOUTH AFRICA 320331	63,900,000	678.46	433,541,339	683.63	436,841,977	8.250000	2032/3/31	0.84
ブラジル	国債証券	BRAZIL-LTN 240701	25,200,000	1,731.32	436,294,366	1,731.98	436,459,186	—	2024/7/1	0.84
メキシコ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	73,700,000	599.01	441,476,722	591.98	436,293,205	10.000000	2024/12/5	0.84
チェコ	国債証券	1.75 CZECH REPUBL 320623	94,200,000	450.45	424,331,531	462.27	435,466,846	1.750000	2032/6/23	0.84
中国	国債証券	1.99 CHINA GOVT 250409	24,000,000	1,810.27	434,465,298	1,805.25	433,260,221	1.990000	2025/4/9	0.84
メキシコ	国債証券	8.5 MEXICAN BONOS 290531	74,000,000	593.26	439,017,893	582.02	430,699,715	8.500000	2029/5/31	0.83
ポーランド	国債証券	2.75 POLAND 291025	16,700,000	2,550.95	426,009,919	2,520.53	420,929,615	2.750000	2029/10/25	0.81
ブラジル	国債証券	10 (IN)BRAZIL NTN 250101	18,950,000	2,194.14	415,791,126	2,208.71	418,551,654	10.000000	2025/1/1	0.81

中国	国債証券	3.22 CHINA GOVT 251206	22,000,000	1,886.13	414,950,308	1,879.75	413,546,670	3.220000	2025/12/6	0.80
南アフリ カ	国債証券	8.875 SOUTH AFRIC 350228	58,700,000	676.93	397,360,076	685.22	402,228,927	8.875000	2035/2/28	0.78
南アフリ カ	国債証券	8.5 SOUTH AFRICA 370131	61,500,000	641.27	394,381,069	648.52	398,843,521	8.500000	2037/1/31	0.77
マレーシ ア	国債証券	3.9 MALAYSIAGOV 261130	13,720,000	2,823.96	387,448,259	2,823.28	387,354,739	3.900000	2026/11/30	0.75
ポーランド	国債証券	2.5 POLAND 260725	14,500,000	2,618.68	379,708,909	2,586.16	374,993,469	2.500000	2026/7/25	0.72
チェコ	国債証券	0.45 CZECH REPUB 231025	76,500,000	487.29	372,780,180	489.41	374,402,942	0.450000	2023/10/25	0.72
マレーシ ア	国債証券	3.8 MALAYSIAGOV 230817	13,100,000	2,811.34	368,285,815	2,811.10	368,254,501	3.800000	2023/8/17	0.71

（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

令和 4年 2月28日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.19
合計	97.19

（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。

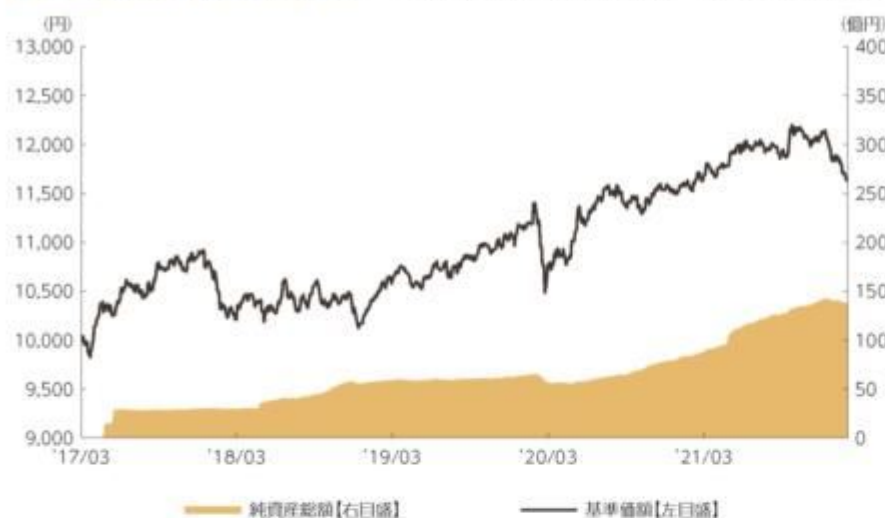
《参考情報》



運用実績

2022年2月28日現在

■基準価額・純資産の推移 2017年3月27日（設定日）～2022年2月28日



- 基準価額は10,000を起点として表示
- 基準価額は運用報酬（信託報酬）控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	11,625円
純資産総額	137.5億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2022年2月	0円
2021年2月	0円
2020年2月	0円
2019年2月	0円
2018年2月	0円
設定来累計	0円

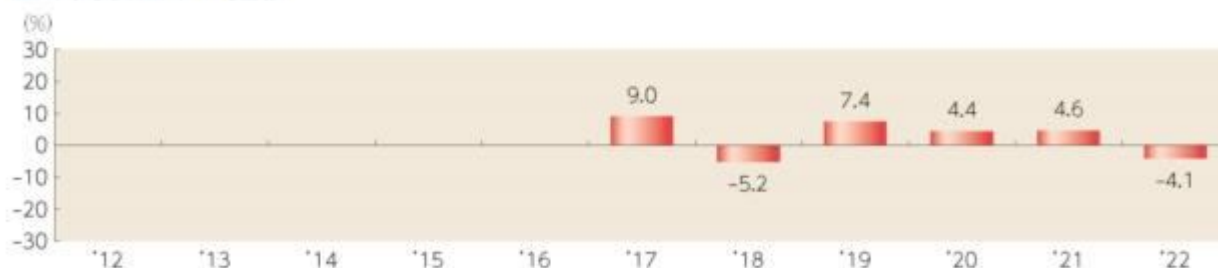
●分配金は1万口当たり、税引前

■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	61.4%
2 グローバル社債ファンドT（適格機関投資家専用）	32.9%
3 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



- 2017年は設定日から年末までの、2022年は年初から2月28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

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国際投信株式会社

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、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

なお、申込みには分配金受取コース（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。

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す。

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国際投信株式会社

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、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。

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国際投信株式会社

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、書面決議の手続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（令和3年2月6日から令和4年2月7日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

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4期 [令和 3年 2月 5日現在]	第5期 [令和 4年 2月 7日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	191,320,973	403,023,702
投資信託受益証券	2,740,878,991	4,586,976,147
親投資信託受益証券	5,359,690,771	9,064,717,236
流動資産合計	8,291,890,735	14,054,717,085
資産合計	8,291,890,735	14,054,717,085
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,090,200	24,714,655
未払受託者報酬	1,569,276	2,969,630
未払委託者報酬	13,338,812	25,241,756
未払利息	35	180
その他未払費用	141,169	267,201
流動負債合計	26,139,492	53,193,422
負債合計	26,139,492	53,193,422
純資産の部		
元本等		
元本	7,138,466,679	11,810,435,273
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,127,284,564	2,191,088,390
（分配準備積立金）	506,462,253	571,731,939
元本等合計	8,265,751,243	14,001,523,663
純資産合計	8,265,751,243	14,001,523,663
負債純資産合計	8,291,890,735	14,054,717,085

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 自 令和2年2月6日 至 令和3年2月5日	第5期 自 令和3年2月6日 至 令和4年2月7日
営業収益		
受取利息	1,033	967
有価証券売買等損益	229,247,184	225,683,621
営業収益合計	229,248,217	225,684,588
営業費用		
支払利息	52,797	62,967
受託者報酬	2,857,562	5,125,354
委託者報酬	24,289,146	43,565,332
その他費用	257,054	461,153
営業費用合計	27,456,559	49,214,806
営業利益又は営業損失（△）	201,791,658	176,469,782
経常利益又は経常損失（△）	201,791,658	176,469,782
当期純利益又は当期純損失（△）	201,791,658	176,469,782
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（△）	△17,066,806	37,803,773
期首剰余金又は期首欠損金（△）	672,683,409	1,127,284,564
剰余金増加額又は欠損金減少額	464,120,082	1,173,669,700
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	464,120,082	1,173,669,700
剰余金減少額又は欠損金増加額	228,377,391	248,531,883
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	228,377,391	248,531,883
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,127,284,564	2,191,088,390

（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。 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。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は令和 3年 2月 6日から令和 4年 2月 7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4期 [令和 3年 2月 5日現在]	第5期 [令和 4年 2月 7日現在]
1. 期首元本額	5,711,818,672円	7,138,466,679円
期中追加設定元本額	3,343,221,903円	6,169,114,566円
期中一部解約元本額	1,916,573,896円	1,497,145,972円
2. 受益権の総数	7,138,466,679口	11,810,435,273口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第4期 自 令和 2年 2月 6日 至 令和 3年 2月 5日			第5期 自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日		
1. 分配金の計算過程			1. 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	84,884,917円	費用控除後の配当等収益額	A	119,729,217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	133,973,547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	18,936,792円
収益調整金額	C	620,822,311円	収益調整金額	C	1,619,356,451円
分配準備積立金額	D	287,603,789円	分配準備積立金額	D	433,065,930円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,127,284,564円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,191,088,390円
当ファンドの期末残存口数	F	7,138,466,679口	当ファンドの期末残存口数	F	11,810,435,273口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,579円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,855円

第4期 自 令和 2年 2月 6日 至 令和 3年 2月 5日			第5期 自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日		
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4期 自 令和 2年 2月 6日 至 令和 3年 2月 5日	第5期 自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7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。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第4期 [令和 3年 2月 5日現在]	第5期 [令和 4年 2月 7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 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。	(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 同左
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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4期 [令和 3年 2月 5日現在]	第5期 [令和 4年 2月 7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	120,629,130	135,267,156
親投資信託受益証券	140,272,850	90,450,603
合計	260,901,980	225,717,759

（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4期 [令和 3年 2月 5日現在]	第5期 [令和 4年 2月 7日現在]
1口当たり純資産額	1.1579円	1.1855円
(1万口当たり純資産額)	(11,579円)	(11,855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）	3,599,887,104	4,586,976,147	
投資信託受益証券 合計		3,599,887,104	4,586,976,147	
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	370,303,293	529,755,890	
	外国債券インデックスマザーファンド	3,742,747,477	8,534,961,346	
親投資信託受益証券 合計		4,113,050,770	9,064,717,236	
合計		7,712,937,874	13,651,693,383	

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)	
[令和 4年 2月 7日現在]	
資産の部	
流動資産	
預金	1,001,674,661
コール・ローン	4,949,802,932
国債証券	285,053,022,243
派生商品評価勘定	67,449,059
未収入金	241,475,560
未収利息	1,649,542,292
前払費用	304,598,945
流動資産合計	293,267,565,692
資産合計	293,267,565,692
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	705,421
未払金	327,447,907
未払解約金	42,305,128
未払利息	2,211
流動負債合計	370,460,667
負債合計	370,460,667
純資産の部	
元本等	
元本	128,438,935,235
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	164,458,169,790
元本等合計	292,897,105,025
純資産合計	292,897,105,025
負債純資産合計	293,267,565,692

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)

	[令和 4年 2月 7日現在]
1. 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	80,266,239,457円
期中追加設定元本額	58,404,186,739円
期中一部解約元本額	10,231,490,961円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）	274,415,119円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）	539,817,308円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）	323,704,793円
三菱UFJ 外国債券オープン	972,663,195円
三菱UFJ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	2,125,494,018円
三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	5,519,885,764円
三菱UFJ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	3,761,385,199円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	582,718,651円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）	94,304,321円
ファンド・マネジャー（海外債券）	617,841,271円
eMAXIS 先進国債券インデックス	4,435,023,068円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	2,095,462,955円
eMAXIS バランス（波乗り型）	234,966,408円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	745,460,862円
コアバランス	1,367,944円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	171,300,949円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	92,999,552円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	51,606,112円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	18,027,604,298円
海外債券セレクション（ラップ向け）	3,742,747,477円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	7,109,327,962円
つみたて8資産均等バランス	3,165,881,058円
つみたて4資産均等バランス	963,243,276円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,752,662円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	579,568円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	89,333円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	86,248,600円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	43,797,449円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	20,771,265円
三菱UFJ DC年金バランス（株式15）	345,584,898円
三菱UFJ DC年金バランス（株式40）	465,165,634円
三菱UFJ DC年金バランス（株式65）	486,740,043円

	[令和 4年 2月 7日現在]
三菱UFJ DC年金インデックス（先進国債券）	459,949,119円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	21,334,506円
三菱UFJ DC年金バランス（株式25）	91,808,038円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金）	4,490,111円
ラップ向けインデックスf 先進国債券	2,495,745,489円
三菱UFJ DC年金バランス（株式80）	635,657円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	737,960円
三菱UFJ 外国債券オープン（確定拠出年金）	2,846,377,585円
ワールド・インカムオープン	1,155,862,208円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	12,272,481,821円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）	436,028,639円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド（年1回決算型）	1,759,419,414円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	516,367,618円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	428,083,973円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	176,619,771円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	122,233,466円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	37,170,887円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	14,652,069円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA（適格機関投資家限定）	1,604,226,068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）	8,861円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2（適格機関投資家限定）	14,874,237円
MUAM 世界債券オープン（適格機関投資家限定）	1,659,795,291円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	26,572,234円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	2,102,648,593円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	1,415,740,096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）	30,725,999,189円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	613,332,561円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	6,130,308円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	887,499円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	1,816,052,972円
アドバンスト・バランスI（FOFs用）（適格機関投資家限定）	76,363,523円
アドバンスト・バランスII（FOFs用）（適格機関投資家限定）	119,794,744円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	114,385,679円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	24,228,148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）	2,839,475,930円

	[令和 4年 2月 7日現在]
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）	107,896,372円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	1,722,311円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	3,792,303円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	1,481,371円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	918,880円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	14,326,066円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	7,713,199円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	17,992,008円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	11,054,866円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	22,496,518円
外国債券インデックスファンドi（適格機関投資家限定）	1,892,019,749円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,899,494,543円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	204,730,869円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	556,627,092円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	432,102,728円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	164,101,084円
合計	128,438,935,235円
2. 受益権の総数	128,438,935,235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 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7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。

区分	自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債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。 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。 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。 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。
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。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 4年 2月 7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	[令和 4年 2月 7日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△10,339,763,410

合計	△10,339,763,410
----	-----------------

(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

〔令和 4年 2月 7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	1,052,290,840	—	1,053,249,786	958,946
	カナダドル	3,630,744	—	3,615,956	△14,788
	オーストラリアドル	4,074,930	—	4,075,000	70
	イギリスポンド	3,119,714	—	3,119,686	△28
	メキシコペソ	3,665,310	—	3,679,764	14,454
	中国元	677,177,399	—	676,486,794	△690,605
	ユーロ	3,155,983,350	—	3,222,458,939	66,475,589
合計		4,899,942,287	—	4,966,685,925	66,743,638

（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）

	〔令和 4年 2月 7日現在〕
1口当たり純資産額	2.2804円
(1万口当たり純資産額)	(22,804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	0.125 T-NOTE 230515	8,700,000.00	8,597,367.18	
		0.125 T-NOTE 230715	5,300,000.00	5,223,191.40	
		0.125 T-NOTE 230815	4,500,000.00	4,428,105.46	
		0.125 T-NOTE 230915	6,350,000.00	6,240,611.32	
		0.125 T-NOTE 231015	4,200,000.00	4,121,742.18	
		0.125 T-NOTE 231215	8,500,000.00	8,319,707.02	
		0.125 T-NOTE 240115	9,100,000.00	8,893,472.65	
		0.125 T-NOTE 240215	6,800,000.00	6,636,906.25	
		0.25 T-NOTE 230615	1,300,000.00	1,284,867.18	
		0.25 T-NOTE 231115	4,700,000.00	4,616,832.02	
		0.25 T-NOTE 250630	6,650,000.00	6,347,632.81	
		0.25 T-NOTE 250731	5,800,000.00	5,525,859.37	
		0.375 T-NOTE 240415	5,300,000.00	5,184,476.56	
		0.375 T-NOTE 240715	7,700,000.00	7,503,289.06	
		0.375 T-NOTE 240815	7,200,000.00	7,007,625.00	
		0.375 T-NOTE 240915	10,000,000.00	9,719,531.25	
		0.375 T-NOTE 250430	1,870,000.00	1,798,121.87	
		0.375 T-NOTE 251130	7,950,000.00	7,561,816.40	
		0.375 T-NOTE 260131	7,700,000.00	7,300,562.50	
		0.375 T-NOTE 270930	8,300,000.00	7,647,023.42	
		0.5 T-NOTE 270430	7,780,000.00	7,280,378.12	
		0.5 T-NOTE 270531	4,280,000.00	3,996,450.00	
		0.5 T-NOTE 270630	6,400,000.00	5,969,500.00	
		0.5 T-NOTE 270831	8,950,000.00	8,316,507.81	
		0.625 T-NOTE 241015	7,400,000.00	7,228,875.00	
		0.625 T-NOTE 260731	7,930,000.00	7,540,934.37	
		0.625 T-NOTE 271231	9,630,000.00	8,964,928.12	
		0.625 T-NOTE 300515	10,140,000.00	9,152,142.18	
		0.625 T-NOTE 300815	12,260,000.00	11,029,689.83	
		0.75 T-NOTE 241115	4,700,000.00	4,601,777.33	

0.75 T-NOTE 260331	15,950,000.00	15,319,476.56	
0.75 T-NOTE 260831	5,500,000.00	5,255,507.80	
0.75 T-NOTE 280131	9,650,000.00	9,040,843.75	
0.875 T-NOTE 260630	8,300,000.00	7,988,750.00	
0.875 T-NOTE 260930	10,000,000.00	9,600,000.00	
0.875 T-NOTE 301115	14,480,000.00	13,278,046.86	
1 T-NOTE 241215	8,000,000.00	7,881,250.00	
1.125 T-BOND 400815	250,000.00	206,093.75	
1.125 T-NOTE 250228	4,150,000.00	4,095,207.02	
1.125 T-NOTE 270228	2,950,000.00	2,855,507.81	
1.125 T-NOTE 310215	10,470,000.00	9,791,494.89	
1.25 T-NOTE 230731	5,830,000.00	5,839,109.37	
1.25 T-NOTE 261130	7,300,000.00	7,124,628.89	
1.25 T-NOTE 280331	8,450,000.00	8,137,085.93	
1.25 T-NOTE 280430	12,200,000.00	11,742,500.00	
1.25 T-NOTE 280630	8,480,000.00	8,150,737.49	
1.25 T-NOTE 280930	8,000,000.00	7,675,624.99	
1.25 T-NOTE 310815	9,690,000.00	9,125,254.67	
1.375 T-BOND 401115	6,700,000.00	5,759,382.81	
1.375 T-NOTE 230630	2,900,000.00	2,909,742.18	
1.375 T-NOTE 230831	6,550,000.00	6,567,910.15	
1.375 T-NOTE 230930	6,450,000.00	6,466,125.00	
1.375 T-NOTE 250131	5,320,000.00	5,291,321.87	
1.375 T-NOTE 311115	11,000,000.00	10,459,453.11	
1.5 T-NOTE 230331	1,950,000.00	1,962,035.14	
1.5 T-NOTE 240930	6,000,000.00	6,001,875.00	
1.5 T-NOTE 241031	4,100,000.00	4,099,679.68	
1.5 T-NOTE 241130	3,930,000.00	3,928,157.81	
1.5 T-NOTE 260815	8,040,000.00	7,952,062.49	
1.5 T-NOTE 270131	3,740,000.00	3,689,305.46	
1.5 T-NOTE 281130	8,850,000.00	8,620,453.12	
1.5 T-NOTE 300215	6,940,000.00	6,738,577.31	
1.625 T-BOND 501115	7,850,000.00	6,812,941.40	
1.625 T-NOTE 230430	2,050,000.00	2,064,574.21	
1.625 T-NOTE 230531	3,650,000.00	3,677,089.84	
1.625 T-NOTE 231031	5,470,000.00	5,504,401.16	
1.625 T-NOTE 260215	7,260,000.00	7,232,207.80	
1.625 T-NOTE 260515	11,770,000.00	11,712,069.53	
1.625 T-NOTE 261031	8,000,000.00	7,951,875.00	
1.625 T-NOTE 261130	3,400,000.00	3,379,281.25	
1.625 T-NOTE 290815	10,020,000.00	9,837,604.68	
1.625 T-NOTE 310515	13,750,000.00	13,413,769.53	

1.75 T-BOND 410815	2,180,000.00	1,991,549.21
1.75 T-NOTE 230515	6,800,000.00	6,856,843.75
1.75 T-NOTE 240731	5,150,000.00	5,188,625.00
1.75 T-NOTE 241231	19,350,000.00	19,466,402.34
1.75 T-NOTE 261231	4,300,000.00	4,297,312.50
1.875 T-BOND 410215	8,100,000.00	7,576,664.05
1.875 T-BOND 510215	9,510,000.00	8,761,087.50
2 T-BOND 500215	5,400,000.00	5,126,835.92
2 T-BOND 510815	8,850,000.00	8,401,277.33
2 T-NOTE 240430	3,600,000.00	3,647,531.25
2 T-NOTE 240531	11,730,000.00	11,885,789.06
2 T-NOTE 240630	5,500,000.00	5,573,046.87
2 T-NOTE 250215	8,110,000.00	8,213,909.37
2 T-NOTE 250815	10,790,000.00	10,914,759.36
2 T-NOTE 261115	10,100,000.00	10,208,101.56
2.125 T-NOTE 231130	3,300,000.00	3,349,628.90
2.125 T-NOTE 240229	7,550,000.00	7,669,148.42
2.125 T-NOTE 240331	10,160,000.00	10,320,337.49
2.125 T-NOTE 240731	3,450,000.00	3,507,949.21
2.125 T-NOTE 240930	8,800,000.00	8,945,062.49
2.125 T-NOTE 241130	1,900,000.00	1,931,023.43
2.125 T-NOTE 250515	7,770,000.00	7,898,690.62
2.125 T-NOTE 260531	3,900,000.00	3,962,460.93
2.25 T-BOND 410515	7,290,000.00	7,238,742.18
2.25 T-BOND 490815	7,180,000.00	7,186,731.24
2.25 T-NOTE 231231	4,190,000.00	4,263,816.01
2.25 T-NOTE 240131	8,750,000.00	8,908,935.54
2.25 T-NOTE 240430	7,600,000.00	7,741,906.25
2.25 T-NOTE 241031	4,800,000.00	4,894,875.00
2.25 T-NOTE 241115	9,550,000.00	9,740,253.90
2.25 T-NOTE 251115	7,390,000.00	7,537,800.00
2.25 T-NOTE 270215	8,090,000.00	8,270,760.93
2.25 T-NOTE 270815	9,690,000.00	9,903,482.80
2.25 T-NOTE 271115	8,090,000.00	8,263,808.59
2.375 T-BOND 491115	4,200,000.00	4,315,500.00
2.375 T-BOND 510515	11,720,000.00	12,084,876.52
2.375 T-NOTE 240815	6,390,000.00	6,535,272.65
2.375 T-NOTE 270515	8,560,000.00	8,802,087.50
2.375 T-NOTE 290515	5,000,000.00	5,162,109.36
2.5 T-BOND 460215	3,450,000.00	3,576,949.21
2.5 T-BOND 460515	3,930,000.00	4,072,155.46
2.5 T-NOTE 230815	7,900,000.00	8,058,617.17
2.5 T-NOTE 240131	6,400,000.00	6,547,000.00

2.5 T-NOTE 240515	9,100,000.00	9,322,523.43	
2.5 T-NOTE 250131	3,350,000.00	3,442,125.00	
2.5 T-NOTE 260228	3,450,000.00	3,553,769.53	
2.625 T-NOTE 230630	2,600,000.00	2,654,437.50	
2.625 T-NOTE 250331	6,310,000.00	6,513,596.08	
2.625 T-NOTE 251231	6,500,000.00	6,728,515.62	
2.625 T-NOTE 260131	4,800,000.00	4,967,250.00	
2.625 T-NOTE 290215	6,410,000.00	6,717,980.45	
2.75 T-BOND 420815	1,320,000.00	1,418,793.74	
2.75 T-BOND 470815	3,060,000.00	3,340,420.31	
2.75 T-BOND 471115	3,370,000.00	3,677,512.50	
2.75 T-NOTE 230430	6,100,000.00	6,224,382.81	
2.75 T-NOTE 230531	6,400,000.00	6,538,249.99	
2.75 T-NOTE 230731	700,000.00	716,515.62	
2.75 T-NOTE 231115	13,040,000.00	13,378,225.00	
2.75 T-NOTE 240215	8,260,000.00	8,493,603.12	
2.75 T-NOTE 250228	6,440,000.00	6,668,418.74	
2.75 T-NOTE 250630	5,170,000.00	5,363,471.09	
2.75 T-NOTE 250831	8,250,000.00	8,555,507.81	
2.75 T-NOTE 280215	10,640,000.00	11,170,337.49	
2.875 T-BOND 430515	3,430,000.00	3,758,797.65	
2.875 T-BOND 450815	2,800,000.00	3,088,531.24	
2.875 T-BOND 461115	3,520,000.00	3,908,299.99	
2.875 T-BOND 490515	5,750,000.00	6,485,820.31	
2.875 T-NOTE 230930	10,150,000.00	10,421,988.28	
2.875 T-NOTE 231031	3,700,000.00	3,802,183.59	
2.875 T-NOTE 250430	6,000,000.00	6,241,406.25	
2.875 T-NOTE 250531	4,230,000.00	4,400,852.34	
2.875 T-NOTE 251130	3,800,000.00	3,965,062.50	
2.875 T-NOTE 280515	12,490,000.00	13,227,690.62	
2.875 T-NOTE 280815	11,510,000.00	12,200,600.00	
3 T-BOND 420515	2,570,000.00	2,871,774.21	
3 T-BOND 441115	3,370,000.00	3,780,455.46	
3 T-BOND 450515	2,990,000.00	3,360,012.50	
3 T-BOND 451115	3,650,000.00	4,114,519.52	
3 T-BOND 470215	4,660,000.00	5,289,100.00	
3 T-BOND 470515	2,790,000.00	3,173,080.07	
3 T-BOND 480215	4,680,000.00	5,358,600.00	
3 T-BOND 480815	12,960,000.00	14,878,687.48	
3 T-BOND 490215	5,790,000.00	6,671,165.61	
3 T-NOTE 250930	4,600,000.00	4,814,546.86	
3 T-NOTE 251031	8,300,000.00	8,693,601.56	

		3.125 T-BOND 411115	1,990,000.00	2,260,671.08	
		3.125 T-BOND 420215	2,750,000.00	3,129,414.06	
		3.125 T-BOND 430215	910,000.00	1,034,556.25	
		3.125 T-BOND 440815	4,850,000.00	5,546,429.66	
		3.125 T-BOND 480515	4,060,000.00	4,760,350.00	
		3.125 T-NOTE 281115	9,940,000.00	10,715,009.37	
		3.375 T-BOND 440515	2,760,000.00	3,274,481.25	
		3.375 T-BOND 481115	12,530,000.00	15,371,764.83	
		3.5 T-BOND 390215	220,000.00	262,367.18	
		3.625 T-BOND 430815	5,300,000.00	6,486,496.08	
		3.625 T-BOND 440215	3,090,000.00	3,793,699.21	
		3.75 T-BOND 410815	11,510,000.00	14,223,842.16	
		3.75 T-BOND 431115	2,630,000.00	3,281,335.93	
		3.875 T-BOND 400815	5,980,000.00	7,474,065.61	
		4.25 T-BOND 390515	570,000.00	743,449.21	
		4.25 T-BOND 401115	2,200,000.00	2,882,171.86	
		4.375 T-BOND 391115	1,930,000.00	2,555,440.62	
		4.375 T-BOND 400515	1,630,000.00	2,167,645.30	
		4.375 T-BOND 410515	1,510,000.00	2,014,552.33	
		4.5 T-BOND 360215	1,000,000.00	1,314,375.00	
		4.5 T-BOND 380515	730,000.00	972,097.65	
		4.5 T-BOND 390815	2,630,000.00	3,532,007.81	
		4.625 T-BOND 400215	5,170,000.00	7,053,414.84	
		4.75 T-BOND 410215	1,600,000.00	2,228,749.98	
		5 T-BOND 370515	1,740,000.00	2,418,328.12	
		5.25 T-BOND 281115	1,530,000.00	1,857,276.55	
		5.375 T-BOND 310215	5,610,000.00	7,243,035.92	
		6 T-BOND 260215	4,900,000.00	5,720,367.18	
		6.125 T-BOND 271115	3,860,000.00	4,768,004.68	
		6.25 T-BOND 230815	4,530,000.00	4,880,013.27	
		6.25 T-BOND 300515	1,150,000.00	1,534,980.46	
アメリカドル合計			1,169,020,000.00	1,191,431,461.16 (137,324,390,213)	
カナダドル	国債証券	0.25 CAN GOVT 240401	3,850,000.00	3,758,085.10	
		0.25 CAN GOVT 260301	1,200,000.00	1,133,626.80	
		0.5 CAN GOVT 301201	5,400,000.00	4,822,005.60	
		1 CAN GOVT 270601	1,430,000.00	1,378,961.87	
		1.25 CAN GOVT 250301	2,100,000.00	2,083,588.50	
		1.25 CAN GOVT 300601	3,510,000.00	3,366,641.07	
		1.5 CAN GOVT 230601	3,410,000.00	3,423,401.30	
		1.5 CAN GOVT 240901	2,000,000.00	2,003,258.00	
		1.5 CAN GOVT 260601	3,200,000.00	3,179,276.80	

		1.5 CAN GOVT 310601	2,900,000.00	2,811,271.60	
		1.75 CAN GOVT 230301	1,800,000.00	1,811,991.60	
		1.75 CAN GOVT 531201	1,440,000.00	1,313,246.88	
		2 CAN GOVT 230901	3,000,000.00	3,034,407.00	
		2 CAN GOVT 280601	1,650,000.00	1,676,734.95	
		2 CAN GOVT 511201	4,660,000.00	4,554,301.88	
		2.25 CAN GOVT 240301	2,150,000.00	2,188,239.90	
		2.25 CAN GOVT 250601	4,600,000.00	4,702,409.80	
		2.25 CAN GOVT 290601	2,210,000.00	2,287,727.91	
		2.5 CAN GOVT 240601	2,700,000.00	2,767,068.00	
		2.75 CAN GOVT 481201	1,230,000.00	1,391,885.22	
		2.75 CANADA GOVER 641201	920,000.00	1,066,187.08	
		3.5 CAN GOVT 451201	1,460,000.00	1,838,959.06	
		4 CAN GOVT 410601	800,000.00	1,038,915.20	
		5 CAN GOVT 370601	770,000.00	1,063,838.16	
		5.75 CAN GOVT 290601	2,450,000.00	3,121,591.55	
		5.75 CAN GOVT 330601	1,050,000.00	1,447,806.15	
カナダドル合計			61,890,000.00	63,265,426.98 (5,719,194,598)	
オーストラリアドル	国債証券	0.25 AUST GOVT 251121	3,450,000.00	3,289,500.34	
		1 AUST GOVT 301221	1,110,000.00	1,027,526.31	
		1 AUST GOVT 311121	5,010,000.00	4,591,325.42	
		1.25 AUST GOVT 320521	2,500,000.00	2,335,978.42	
		1.5 AUST GOVT 310621	2,590,000.00	2,495,629.54	
		1.75 AUST GOVT 321121	1,880,000.00	1,838,813.50	
		1.75 AUST GOVT 510621	1,990,000.00	1,674,228.31	
		2.25 AUST GOVT 280521	1,250,000.00	1,286,454.87	
		2.5 AUST GOVT 300521	3,940,000.00	4,126,663.80	
		2.75 AUST GOVT 240421	900,000.00	935,337.78	
		2.75 AUST GOVT 271121	2,090,000.00	2,209,086.52	
		2.75 AUST GOVT 281121	1,930,000.00	2,047,763.00	
		2.75 AUST GOVT 291121	3,110,000.00	3,310,780.97	
		2.75 AUST GOVT 350621	1,330,000.00	1,429,193.52	
		2.75 AUST GOVT 410521	320,000.00	336,107.04	
		3 AUST GOVT 470321	1,460,000.00	1,591,366.56	
		3.25 AUST GOVT 250421	2,760,000.00	2,919,871.34	
		3.25 AUST GOVT 290421	3,160,000.00	3,463,772.69	
		3.25 AUST GOVT 390621	2,040,000.00	2,306,276.10	
		3.75 AUST GOVT 370421	1,750,000.00	2,097,619.82	
		4.25 AUST GOVT 260421	3,320,000.00	3,682,100.11	
		4.5 AUST GOVT 330421	2,210,000.00	2,769,867.91	
		4.75 AUST GOVT 270421	2,700,000.00	3,115,977.66	

オーストラリアドル合計			52,800,000.00	54,881,241.53 (4,472,821,184)	
イギリス ポンド	国債証券	0.125 GILT 230131	800,000.00	792,136.00	
		0.125 GILT 240131	2,600,000.00	2,542,699.64	
		0.125 GILT 260130	2,000,000.00	1,914,151.60	
		0.25 GILT 310731	2,360,000.00	2,118,630.55	
		0.375 GILT 301022	2,390,000.00	2,198,453.92	
		0.625 GILT 250607	1,380,000.00	1,353,021.00	
		0.625 GILT 350731	2,090,000.00	1,859,594.63	
		0.625 GILT 501022	1,240,000.00	994,194.80	
		0.75 GILT 230722	2,450,000.00	2,436,310.38	
		0.875 GILT 291022	2,060,000.00	1,994,574.40	
		0.875 GILT 460131	970,000.00	839,874.50	
		1 GILT 240422	1,700,000.00	1,692,112.00	
		1.125 GILT 390131	1,010,000.00	945,461.00	
		1.25 GILT 270722	1,770,000.00	1,769,079.60	
		1.25 GILT 411022	2,630,000.00	2,490,610.00	
		1.25 GILT 510731	570,000.00	535,654.99	
		1.5 GILT 260722	3,490,000.00	3,530,377.55	
		1.5 GILT 470722	1,840,000.00	1,830,638.08	
		1.625 GILT 281022	1,540,000.00	1,574,797.84	
		1.625 GILT 541022	1,330,000.00	1,387,507.32	
		1.625 GILT 711022	1,530,000.00	1,749,769.20	
		1.75 GILT 370907	2,030,000.00	2,088,058.00	
		1.75 GILT 490122	1,180,000.00	1,243,915.88	
		1.75 GILT 570722	2,130,000.00	2,333,031.60	
		2 GILT 250907	1,760,000.00	1,806,333.76	
		2.25 GILT 230907	3,200,000.00	3,252,377.60	
		2.5 GILT 650722	2,060,000.00	2,866,078.00	
		2.75 GILT 240907	1,900,000.00	1,972,130.08	
		3.25 GILT 440122	2,730,000.00	3,594,727.50	
		3.5 GILT 450122	2,700,000.00	3,715,605.00	
		3.5 GILT 680722	1,840,000.00	3,241,068.00	
		3.75 GILT 520722	1,930,000.00	2,996,054.80	
		4 GILT 600122	1,610,000.00	2,863,304.50	
		4.25 GILT 271207	2,320,000.00	2,704,153.02	
		4.25 GILT 320607	2,750,000.00	3,490,660.25	
		4.25 GILT 360307	2,250,000.00	3,036,421.80	
		4.25 GILT 390907	1,450,000.00	2,061,334.50	
		4.25 GILT 401207	1,740,000.00	2,512,029.30	
		4.25 GILT 461207	2,350,000.00	3,661,195.19	
		4.25 GILT 491207	980,000.00	1,589,814.80	

		4.25 GILT 551207	2,290,000.00	4,006,829.48	
		4.5 GILT 340907	1,630,000.00	2,191,357.64	
		4.5 GILT 421207	2,250,000.00	3,436,161.30	
		4.75 GILT 301207	2,330,000.00	2,990,088.53	
		4.75 GILT 381207	1,730,000.00	2,564,033.00	
		5 GILT 250307	2,070,000.00	2,302,405.51	
		6 GILT 281207	1,540,000.00	2,013,167.77	
イギリスポンド合計			90,500,000.00	107,081,985.81 (16,703,718,966)	
シンガ ポールド ル	国債証券	1.875 SINGAPORGOV 500301	700,000.00	666,400.00	
		1.875 SINGAPORGOV 511001	950,000.00	911,154.50	
		2.125 SINGAPORGOV 260601	1,530,000.00	1,570,086.00	
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	1,080,000.00	1,115,186.40	
		2.375 SINGAPORGOV 250601	600,000.00	620,340.00	
		2.375 SINGAPORGOV 390701	380,000.00	400,900.00	
		2.625 SINGAPORGOV 280501	800,000.00	844,560.00	
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	960,000.00	1,074,657.60	
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	790,000.00	888,355.00	
		2.875 SINGAPORGOV 290701	920,000.00	991,760.00	
		2.875SINGAPORGOVT 300901	2,240,000.00	2,433,760.00	
		3 SINGAPORGOVT 240901	1,000,000.00	1,044,300.00	
		3.375 SINGAPORGOV 330901	780,000.00	895,830.00	
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	760,000.00	829,540.00	
シンガポールドル合計			13,490,000.00	14,286,829.50 (1,224,095,551)	
マレーシ アリン ギット	国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	1,800,000.00	1,652,777.06	
		3.48 MALAYSIAGOVT 230315	1,600,000.00	1,623,268.48	
		3.502MALAYSIAGOVT 270531	1,400,000.00	1,408,186.92	
		3.733 MALAYSIAGO 280615	2,100,000.00	2,123,998.59	
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	1,880,000.00	1,760,618.74	
		3.8 MALAYSIAGOVT 230817	1,200,000.00	1,226,807.40	
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	2,300,000.00	2,252,721.89	
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	1,400,000.00	1,391,635.07	
		3.882 MALAYSIAGOV 250314	1,000,000.00	1,026,151.40	
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	2,000,000.00	2,030,649.40	
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	1,500,000.00	1,537,147.35	
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	1,100,000.00	1,127,325.21	
		3.9 MALAYSIAGOVT 261130	4,500,000.00	4,623,067.80	
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	1,400,000.00	1,437,029.86	
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3,920,000.00	4,038,541.58	
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4,100,000.00	4,226,387.83	
		4.232MALAYSIAGOVT 310630	2,750,000.00	2,851,822.32	

		4.254 MALAYSIAGOV 350531	2,150,000.00	2,194,684.09	
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	900,000.00	941,997.78	
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	2,240,000.00	2,371,579.84	
		4.642 MALAYSIAGOV 331107	1,200,000.00	1,275,171.84	
		4.736 MALAYSIAGOV 460315	1,650,000.00	1,721,753.71	
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	3,340,000.00	3,623,288.44	
		4.893 MALAYSIAGOV 380608	400,000.00	431,112.44	
		4.921 MALAYSIAGOV 480706	2,020,000.00	2,147,710.05	
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	2,200,000.00	2,357,704.58	
マレーシアリングット合計			52,050,000.00	53,403,139.67 (1,470,669,063)	
スウェーデンクローネ	国債証券	0.125 SWD GOVT 310512	7,850,000.00	7,509,952.52	
		0.75 SWD GOVT 280512	6,900,000.00	6,980,797.62	
		0.75 SWD GOVT 291112	6,300,000.00	6,366,937.50	
		1 SWD GOVT 261112	10,460,000.00	10,697,442.00	
		1.5 SWD GOVT 231113	9,940,000.00	10,189,325.02	
		2.25 SWD GOVT 320601	4,350,000.00	5,060,376.75	
		2.5 SWD GOVT 250512	8,260,000.00	8,836,938.67	
		3.5 SWD GOVT 390330	5,470,000.00	7,881,274.46	
スウェーデンクローネ合計			59,530,000.00	63,523,044.54 (801,025,591)	
ノルウェークローネ	国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	3,500,000.00	3,246,582.50	
		1.375 NORWE GOVT 300819	7,570,000.00	7,152,249.55	
		1.5 NORWE GOVT 260219	4,860,000.00	4,767,339.24	
		1.75 NORWE GOVT 250313	8,950,000.00	8,904,005.95	
		1.75 NORWE GOVT 270217	4,170,000.00	4,112,287.20	
		1.75 NORWE GOVT 290906	4,200,000.00	4,103,463.00	
		2 NORWE GOVT 230524	5,920,000.00	5,965,110.40	
		2 NORWE GOVT 280426	6,200,000.00	6,180,569.20	
			8,300,000.00	8,511,235.00	
ノルウェークローネ合計			53,670,000.00	52,942,842.04 (693,021,802)	
デンマーククローネ	国債証券	0 DMK GOVT 311115	7,500,000.00	7,174,824.30	
		0.25 DMK GOVT 521115	5,400,000.00	5,058,180.00	
		0.5 DMK GOVT 271115	9,050,000.00	9,188,865.01	
		0.5 DMK GOVT 291115	10,550,000.00	10,700,021.00	
		1.5 DMK GOVT 231115	3,250,000.00	3,351,864.75	
		1.75 DMK GOVT 251115	10,490,000.00	11,155,443.64	
		4.5 DMK GOVT 391115	13,440,000.00	22,805,931.45	
デンマーククローネ合計			59,680,000.00	69,435,130.15 (1,231,084,857)	
	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	47,950,000.00	50,963,014.97	

メキシコ ペソ		10 MEXICAN BONOS 361120	13,150,000.00	15,750,906.94	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	57,900,000.00	54,369,859.57	
		6.75 MEXICAN BONO 230309	16,000,000.00	15,940,800.00	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	40,250,000.00	40,194,530.26	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	34,350,000.00	34,636,822.50	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	11,200,000.00	11,254,992.00	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	23,890,000.00	23,243,775.50	
		8 MEXICAN BONOS 231207	33,430,000.00	33,717,742.03	
		8 MEXICAN BONOS 240905	5,000,000.00	5,057,450.00	
		8 MEXICAN BONOS 471107	21,900,000.00	21,858,759.89	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	35,050,000.00	36,928,571.34	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	25,700,000.00	27,112,839.51	
メキシコペソ合計			365,770,000.00	371,030,064.51 (2,069,049,154)	
イスラエル シェケ ル	国債証券	0.5 ISRAEL FIXED 250430	4,000,000.00	3,986,800.00	
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	1,900,000.00	1,843,475.00	
		1.5 ISRAEL FIXED 370531	2,400,000.00	2,192,880.00	
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	4,180,000.00	4,506,876.00	
		3.75 ISRAEL FIXED 240331	6,250,000.00	6,892,187.50	
		3.75 ISRAEL FIXED 470331	1,950,000.00	2,382,997.50	
		4.25 ISRAEL FIXED 230331	1,880,000.00	2,037,074.00	
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	3,180,000.00	4,737,723.00	
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	4,700,000.00	5,932,340.00	
イスラエルシェケル合計			30,440,000.00	34,512,353.00 (1,241,295,446)	
ポーランド ズロチ	国債証券	1.25 POLAND 301025	2,090,000.00	1,705,378.80	
		2.25 POLAND 241025	4,000,000.00	3,864,000.92	
		2.5 POLAND 240425	2,600,000.00	2,542,281.97	
		2.5 POLAND 260725	6,540,000.00	6,188,139.75	
		2.5 POLAND 270725	5,190,000.00	4,835,155.63	
		2.75 POLAND 280425	7,760,000.00	7,291,296.00	
		2.75 POLAND 291025	3,400,000.00	3,147,890.00	
		3.25 POLAND 250725	7,300,000.00	7,178,085.67	
		4 POLAND 231025	4,300,000.00	4,330,315.00	
		5.75 POLAND 290425	3,450,000.00	3,876,592.50	
ポーランドズロチ合計			46,630,000.00	44,959,136.24 (1,300,060,863)	
中国元	国債証券	2.36 CHINA GOVT 230702	16,000,000.00	16,050,521.60	
		2.56 CHINA GOVT 231021	9,000,000.00	9,067,209.30	
		2.68 CHINA GOVT 300521	1,000,000.00	990,611.61	
		2.69 CHINA GOVT 260812	1,000,000.00	1,012,512.40	
		2.85 CHINA GOVT 270604	6,000,000.00	6,108,661.80	

		2.89 CHINA GOVT 311118	5,000,000.00	5,079,171.50	
		2.9 CHINA GOVT 260505	6,000,000.00	6,110,400.00	
		3.01 CHINA GOVT 280513	6,000,000.00	6,135,773.40	
		3.02 CHINA GOVT 310527	4,000,000.00	4,089,718.80	
		3.03 CHINA GOVT 260311	8,000,000.00	8,189,248.80	
		3.27 CHINA GOVT 301119	6,000,000.00	6,233,566.20	
		3.39 CHINA GOVT 500316	4,000,000.00	4,021,625.20	
		3.54 CHINA GOVT 280816	6,000,000.00	6,361,754.40	
		3.57 CHINA GOVT 240622	10,000,000.00	10,332,295.00	
		3.61 CHINA GOVT 250607	10,000,000.00	10,449,625.00	
		3.72 CHINA GOVT 510412	4,000,000.00	4,290,462.40	
		3.81 CHINA GOVT 500914	4,000,000.00	4,335,336.40	
中国元合計			106,000,000.00	108,858,493.81 (1,973,081,972)	
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 300220	1,450,000.00	1,401,327.85	
		0 AUSTRIA GOVT 310220	1,350,000.00	1,290,723.52	
		0 AUSTRIA GOVT 401020	550,000.00	478,870.15	
		0 BEL GOVT 311022	1,700,000.00	1,607,707.00	
		0 BUND 260815	4,680,000.00	4,686,917.04	
		0 BUND 271115	2,150,000.00	2,144,246.60	
		0 BUND 290815	990,000.00	983,829.33	
		0 BUND 300215	2,120,000.00	2,104,004.60	
		0 BUND 300815	4,960,000.00	4,911,555.68	
		0 BUND 310815	1,650,000.00	1,622,822.02	
		0 BUND 350515	4,580,000.00	4,425,210.70	
		0 BUND 500815	3,750,000.00	3,420,570.00	
		0 BUND 520815	900,000.00	808,200.00	
		0 FINNISH GOVT 240915	850,000.00	854,361.35	
		0 FINNISH GOVT 300915	750,000.00	724,094.88	
		0 NETH GOVT 240115	1,540,000.00	1,548,770.30	
		0 NETH GOVT 300715	3,150,000.00	3,075,644.25	
		0 NETH GOVT 520115	1,300,000.00	1,123,971.81	
		0 O.A.T 240225	2,000,000.00	2,010,130.00	
		0 O.A.T 240325	2,000,000.00	2,009,584.00	
		0 O.A.T 250325	5,280,000.00	5,283,653.22	
		0 O.A.T 260225	4,600,000.00	4,576,236.40	
		0 O.A.T 291125	4,730,000.00	4,575,460.25	
		0 O.A.T 301125	5,340,000.00	5,104,612.80	
		0 O.A.T 311125	5,200,000.00	4,904,749.20	
		0 OBL 241018	6,900,000.00	6,943,759.80	
		0 OBL 261009	2,900,000.00	2,900,469.80	
		0 SPAIN GOVT 240531	3,100,000.00	3,093,641.90	

0 SPAIN GOVT 250131	8,930,000.00	8,884,037.29	
0 SPAIN GOVT 260131	7,100,000.00	6,996,787.30	
0 SPAIN GOVT 270131	600,000.00	584,465.40	
0 SPAIN GOVT 280131	4,800,000.00	4,617,395.71	
0.1 BEL GOVT 300622	1,500,000.00	1,458,789.09	
0.1 SPAIN GOVT 310430	2,660,000.00	2,459,691.36	
0.125 FINNISH GOV 360415	610,000.00	566,284.96	
0.125 FINNISH GOV 520415	360,000.00	303,827.45	
0.2 IRISH GOVT 301018	320,000.00	311,636.64	
0.25 BUND 270215	4,390,000.00	4,442,754.63	
0.25 BUND 280815	3,540,000.00	3,583,973.88	
0.25 BUND 290215	5,700,000.00	5,773,222.20	
0.25 FINNISH GOVT 400915	350,000.00	323,578.85	
0.25 NETH GOVT 250715	1,930,000.00	1,949,589.50	
0.25 NETH GOVT 290715	2,300,000.00	2,300,609.50	
0.25 O.A.T 261125	4,750,000.00	4,761,561.50	
0.35 ITALY GOVT 250201	2,560,000.00	2,542,239.28	
0.35 SPAIN GOVT 230730	2,720,000.00	2,739,586.72	
0.4 BEL GOVT 400622	600,000.00	548,328.00	
0.4 IRISH GOVT 350515	700,000.00	667,925.30	
0.5 AUSTRIA GOVT 270420	1,400,000.00	1,422,101.80	
0.5 AUSTRIA GOVT 290220	1,310,000.00	1,323,859.80	
0.5 BEL GOVT 241022	1,740,000.00	1,771,702.80	
0.5 BUND 250215	5,360,000.00	5,474,082.24	
0.5 BUND 260215	6,420,000.00	6,564,719.64	
0.5 BUND 270815	3,820,000.00	3,918,899.80	
0.5 BUND 280215	3,230,000.00	3,316,438.03	
0.5 FINNISH GOVT 260415	1,670,000.00	1,700,247.54	
0.5 FINNISH GOVT 270915	700,000.00	712,066.25	
0.5 FINNISH GOVT 280915	580,000.00	587,841.60	
0.5 FINNISH GOVT 290915	720,000.00	729,331.20	
0.5 ITALY GOVT 260201	1,850,000.00	1,825,668.80	
0.5 ITALY GOVT 280715	2,000,000.00	1,906,942.72	
0.5 NETH GOVT 260715	3,150,000.00	3,211,453.35	
0.5 NETH GOVT 400115	1,520,000.00	1,539,963.07	
0.5 O.A.T 250525	5,940,000.00	6,039,993.96	
0.5 O.A.T 260525	5,300,000.00	5,379,706.70	
0.5 O.A.T 290525	4,400,000.00	4,435,525.60	
0.5 O.A.T 400525	2,450,000.00	2,289,250.21	
0.5 O.A.T 440625	1,150,000.00	1,047,337.83	
0.5 O.A.T 720525	1,100,000.00	797,998.30	
0.5 SPAIN GOVT 300430	830,000.00	808,942.90	

0.5 SPAIN GOVT 311031	6,500,000.00	6,176,053.00
0.6 ITALY GOVT 310801	3,750,000.00	3,407,177.20
0.65 BEL GOVT 710622	510,000.00	391,906.44
0.65 ITALY GOVT 231015	4,720,000.00	4,760,592.00
0.75 AUSTRIA GOVT 261020	1,940,000.00	1,994,060.04
0.75 AUSTRIA GOVT 280220	1,510,000.00	1,553,380.79
0.75 AUSTRIA GOVT 510320	580,000.00	568,968.98
0.75 FINNISH GOVT 310415	820,000.00	844,092.42
0.75 NETH GOVT 270715	2,670,000.00	2,760,144.54
0.75 NETH GOVT 280715	2,150,000.00	2,229,773.60
0.75 O.A.T 280525	6,000,000.00	6,166,908.00
0.75 O.A.T 281125	6,960,000.00	7,150,091.52
0.75 O.A.T 520525	3,690,000.00	3,374,213.49
0.75 O.A.T 530525	460,000.00	415,546.98
0.8 BEL GOVT 250622	2,170,000.00	2,230,477.90
0.8 BEL GOVT 270622	1,330,000.00	1,370,791.10
0.8 BEL GOVT 280622	2,450,000.00	2,531,033.75
0.8 SPAIN GOVT 270730	4,800,000.00	4,859,908.80
0.85 ITALY GOVT 270115	2,710,000.00	2,688,782.13
0.875 FINNISH GOV 250915	630,000.00	650,940.57
0.9 BEL GOVT 290622	2,280,000.00	2,369,218.68
0.9 IRISH GOVT 280515	1,860,000.00	1,927,558.92
0.9 ITALY GOVT 310401	2,830,000.00	2,658,275.60
0.95 ITALY GOVT 370301	1,660,000.00	1,442,584.82
1 BEL GOVT 260622	1,640,000.00	1,702,194.04
1 BEL GOVT 310622	1,800,000.00	1,881,414.00
1 BUND 240815	3,300,000.00	3,406,052.10
1 BUND 250815	5,940,000.00	6,173,216.28
1 IRISH GOVT 260515	1,640,000.00	1,698,833.36
1 O.A.T 251125	4,480,000.00	4,636,584.96
1 O.A.T 270525	5,450,000.00	5,668,436.00
1 SPAIN GOVT 501031	2,380,000.00	2,015,412.56
1.1 IRISH GOVT 290515	1,400,000.00	1,467,256.00
1.125 FINNISH GOV 340415	630,000.00	672,003.36
1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1,110,000.00	1,158,552.51
1.2 SPAIN GOVT 401031	1,430,000.00	1,362,242.65
1.25 BEL GOVT 330422	1,030,000.00	1,108,469.61
1.25 BUND 480815	3,600,000.00	4,474,080.00
1.25 ITALY GOVT 261201	2,680,000.00	2,716,391.72
1.25 O.A.T 340525	5,070,000.00	5,389,851.09
1.25 O.A.T 360525	3,750,000.00	3,995,786.25
1.25 SPAIN GOVT 301031	6,830,000.00	7,028,295.39
1.3 IRISH GOVT 330515	1,330,000.00	1,416,263.80

1.35 IRISH GOVT 310318	1,070,000.00	1,152,003.73	
1.35 ITALY GOVT 300401	2,910,000.00	2,884,723.74	
1.375 FINNISH GOV 470415	540,000.00	634,541.04	
1.4 SPAIN GOVT 280430	4,840,000.00	5,064,832.52	
1.45 BEL GOVT 370622	1,020,000.00	1,117,398.78	
1.45 ITALY GOVT 241115	2,400,000.00	2,459,467.20	
1.45 ITALY GOVT 250515	1,600,000.00	1,640,985.60	
1.45 ITALY GOVT 360301	1,940,000.00	1,835,228.36	
1.45 SPAIN GOVT 271031	2,730,000.00	2,863,142.10	
1.45 SPAIN GOVT 290430	2,960,000.00	3,111,016.24	
1.45 SPAIN GOVT 711031	620,000.00	497,799.86	
1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1,050,000.00	1,231,293.00	
1.5 AUSTRIA GOVT 861102	360,000.00	425,421.00	
1.5 BUND 240515	4,460,000.00	4,643,613.74	
1.5 IRISH GOVT 500515	780,000.00	865,450.56	
1.5 ITALY GOVT 250601	2,500,000.00	2,567,906.00	
1.5 O.A.T 310525	6,400,000.00	6,963,360.00	
1.5 O.A.T 500525	3,890,000.00	4,332,363.02	
1.6 BEL GOVT 470622	1,370,000.00	1,541,252.74	
1.6 ITALY GOVT 260601	3,820,000.00	3,934,103.40	
1.6 SPAIN GOVT 250430	3,510,000.00	3,670,266.60	
1.65 AUSTRIA GOVT 241021	4,530,000.00	4,753,396.95	
1.65 ITALY GOVT 301201	3,470,000.00	3,491,465.42	
1.65 ITALY GOVT 320301	3,350,000.00	3,347,356.85	
1.7 BEL GOVT 500622	1,210,000.00	1,388,975.80	
1.7 IRISH GOVT 370515	1,180,000.00	1,330,514.90	
1.7 ITALY GOVT 510901	2,060,000.00	1,796,694.92	
1.75 BUND 240215	6,650,000.00	6,933,512.77	
1.75 NETH GOVT 230715	190,000.00	195,964.10	
1.75 O.A.T 241125	9,820,000.00	10,330,473.06	
1.75 O.A.T 390625	3,760,000.00	4,361,163.84	
1.75 O.A.T 660525	1,750,000.00	2,089,634.75	
1.8 ITALY GOVT 410301	1,740,000.00	1,649,394.72	
1.85 ITALY GOVT 240515	4,370,000.00	4,513,486.32	
1.85 SPAIN GOVT 350730	2,300,000.00	2,468,642.90	
1.9 BEL GOVT 380622	1,110,000.00	1,296,182.52	
1.95 SPAIN GOVT 260430	4,570,000.00	4,873,463.53	
1.95 SPAIN GOVT 300730	2,590,000.00	2,822,426.60	
2 FINNISH GOVT 240415	420,000.00	441,304.92	
2 IRISH GOVT 450218	1,220,000.00	1,500,661.00	
2 ITALY GOVT 251201	2,680,000.00	2,803,280.00	
2 ITALY GOVT 280201	4,880,000.00	5,117,792.64	

2 NETH GOVT 240715	1,800,000.00	1,897,433.81
2 O.A.T 480525	3,510,000.00	4,336,180.29
2.05 ITALY GOVT 270801	3,050,000.00	3,204,717.35
2.1 AUSTRIA GOVT 170920	1,120,000.00	1,603,277.28
2.1 ITALY GOVT 260715	2,350,000.00	2,471,527.90
2.15 BEL GOVT 660622	890,000.00	1,173,356.42
2.15 SPAIN GOVT 251031	2,680,000.00	2,866,997.00
2.2 ITALY GOVT 270601	2,500,000.00	2,647,850.00
2.25 BEL GOVT 570622	780,000.00	1,024,310.82
2.25 ITALY GOVT 360901	2,120,000.00	2,211,918.96
2.25 O.A.T 240525	6,190,000.00	6,538,459.86
2.35 SPAIN GOVT 330730	3,010,000.00	3,405,005.31
2.4 AUSTRIA GOVT 340523	1,760,000.00	2,146,846.24
2.4 IRISH GOVT 300515	1,640,000.00	1,901,727.60
2.45 ITALY GOVT 231001	550,000.00	571,073.80
2.45 ITALY GOVT 330901	2,470,000.00	2,649,662.86
2.45 ITALY GOVT 500901	1,990,000.00	2,049,668.16
2.5 BUND 440704	3,500,000.00	5,245,957.50
2.5 BUND 460815	3,760,000.00	5,782,552.88
2.5 ITALY GOVT 241201	3,830,000.00	4,039,726.20
2.5 ITALY GOVT 251115	2,330,000.00	2,480,979.34
2.5 NETH GOVT 330115	1,810,000.00	2,216,591.16
2.5 O.A.T 300525	6,850,000.00	8,013,698.55
2.6 BEL GOVT 240622	2,980,000.00	3,179,785.16
2.625 FINNISH GOV 420704	680,000.00	941,725.20
2.7 ITALY GOVT 470301	2,260,000.00	2,471,285.14
2.7 SPAIN GOVT 481031	1,820,000.00	2,249,837.94
2.75 FINNISH GOVT 280704	730,000.00	847,577.45
2.75 NETH GOVT 470115	2,490,000.00	3,869,594.46
2.75 O.A.T 271025	6,690,000.00	7,648,944.60
2.8 ITALY GOVT 281201	2,880,000.00	3,166,594.56
2.8 ITALY GOVT 670301	2,180,000.00	2,285,987.24
2.9 SPAIN GOVT 461031	2,310,000.00	2,941,540.14
2.95 ITALY GOVT 380901	1,600,000.00	1,814,035.20
3 BEL GOVT 340622	930,000.00	1,188,894.33
3 ITALY GOVT 290801	2,800,000.00	3,127,975.20
3.1 ITALY GOVT 400301	1,640,000.00	1,896,926.49
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	840,000.00	1,272,274.08
3.25 BUND 420704	2,480,000.00	3,989,980.24
3.25 ITALY GOVT 460901	2,230,000.00	2,665,559.14
3.25 O.A.T 450525	3,460,000.00	5,120,357.12
3.35 ITALY GOVT 350301	1,830,000.00	2,141,956.44
3.4 IRISH GOVT 240318	820,000.00	882,615.20

3.45 ITALY GOVT 480301	2,100,000.00	2,599,031.40	
3.45 SPAIN GOVT 660730	1,790,000.00	2,514,726.25	
3.5 ITALY GOVT 300301	3,750,000.00	4,347,618.75	
3.5 O.A.T 260425	5,590,000.00	6,388,302.31	
3.75 BEL GOVT 450622	1,250,000.00	1,976,437.50	
3.75 ITALY GOVT 240901	3,230,000.00	3,498,920.11	
3.75 NETH GOVT 420115	2,210,000.00	3,617,504.80	
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	560,000.00	1,100,156.40	
3.8 SPAIN GOVT 240430	6,210,000.00	6,734,785.98	
3.85 ITALY GOVT 490901	1,640,000.00	2,170,357.96	
4 BEL GOVT 320328	1,140,000.00	1,533,814.14	
4 BUND 370104	3,480,000.00	5,448,543.77	
4 FINNISH GOVT 250704	640,000.00	729,516.80	
4 ITALY GOVT 370201	3,460,000.00	4,380,574.52	
4 NETH GOVT 370115	2,650,000.00	4,021,536.65	
4 O.A.T 381025	3,190,000.00	4,812,290.45	
4 O.A.T 550425	2,500,000.00	4,533,085.00	
4 O.A.T 600425	2,150,000.00	4,074,697.84	
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	1,870,000.00	2,838,882.53	
4.2 SPAIN GOVT 370131	2,950,000.00	4,131,538.42	
4.25 BEL GOVT 410328	2,200,000.00	3,497,689.80	
4.25 BUND 390704	2,150,000.00	3,648,829.50	
4.25 O.A.T 231025	2,490,000.00	2,687,052.62	
4.4 SPAIN GOVT 231031	3,300,000.00	3,557,380.20	
4.5 BEL GOVT 260328	1,790,000.00	2,122,213.26	
4.5 ITALY GOVT 230501	3,950,000.00	4,173,483.10	
4.5 ITALY GOVT 240301	5,920,000.00	6,425,212.80	
4.5 ITALY GOVT 260301	3,440,000.00	3,946,196.00	
4.5 O.A.T 410425	4,500,000.00	7,409,592.00	
4.65 SPAIN GOVT 250730	410,000.00	472,934.38	
4.7 SPAIN GOVT 410730	2,620,000.00	4,085,468.18	
4.75 BUND 280704	1,990,000.00	2,596,777.86	
4.75 BUND 340704	3,700,000.00	5,816,740.40	
4.75 BUND 400704	2,490,000.00	4,548,642.36	
4.75 ITALY GOVT 230801	5,080,000.00	5,434,426.52	
4.75 ITALY GOVT 280901	3,090,000.00	3,772,679.88	
4.75 ITALY GOVT 440901	2,520,000.00	3,687,881.40	
4.75 O.A.T 350425	3,970,000.00	6,009,222.26	
4.8 SPAIN GOVT 240131	3,790,000.00	4,150,034.84	
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	1,370,000.00	1,643,830.12	
4.9 SPAIN GOVT 400730	3,090,000.00	4,878,172.18	
5 BEL GOVT 350328	2,540,000.00	3,925,849.40	

	5 ITALY GOVT 250301	4,050,000.00	4,590,679.44	
	5 ITALY GOVT 340801	2,500,000.00	3,391,940.00	
	5 ITALY GOVT 390801	2,610,000.00	3,753,963.00	
	5 ITALY GOVT 400901	2,690,000.00	3,917,611.09	
	5.15 SPAIN GOVT 281031	2,800,000.00	3,618,498.80	
	5.15 SPAIN GOVT 441031	2,070,000.00	3,530,613.11	
	5.25 ITALY GOVT 291101	4,410,000.00	5,680,551.87	
	5.4 IRISH GOVT 250313	1,100,000.00	1,284,187.08	
	5.4 SPAIN GOVT 230131	1,820,000.00	1,922,786.32	
	5.5 BEL GOVT 280328	2,760,000.00	3,656,254.80	
	5.5 BUND 310104	5,300,000.00	7,880,379.20	
	5.5 NETH GOVT 280115	2,080,000.00	2,738,372.00	
	5.5 O.A.T 290425	6,160,000.00	8,426,399.52	
	5.625 BUND 280104	2,790,000.00	3,722,186.43	
	5.75 ITALY GOVT 330201	2,410,000.00	3,389,373.39	
	5.75 O.A.T 321025	4,760,000.00	7,328,672.12	
	5.75 SPAIN GOVT 320730	3,190,000.00	4,689,963.52	
	6 ITALY GOVT 310501	4,640,000.00	6,426,455.68	
	6 O.A.T 251025	3,490,000.00	4,267,788.38	
	6.25 AUSTRIA GOVT 270715	1,240,000.00	1,651,181.52	
	6.25 BUND 300104	3,550,000.00	5,301,289.55	
	6.5 BUND 270704	2,250,000.00	3,047,145.75	
	6.5 ITALY GOVT 271101	3,650,000.00	4,743,346.55	
	7.25 ITALY GOVT 261101	2,300,000.00	2,974,780.90	
	9 ITALY GOVT 231101	3,350,000.00	3,859,672.35	
ユーロ合計		729,490,000.00	824,590,945.47 (108,829,512,983)	
合計			285,053,022,243 (285,053,022,243)	

(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 188銘柄	100.00%	48.18%
カナダドル	国債証券 26銘柄	100.00%	2.01%
オーストラリアドル	国債証券 23銘柄	100.00%	1.57%
イギリスポンド	国債証券 47銘柄	100.00%	5.86%
シンガポールドル	国債証券 14銘柄	100.00%	0.43%
マレーシアリングット	国債証券 26銘柄	100.00%	0.52%

スウェーデンクローネ	国債証券	8銘柄	100.00%	0.28%
ノルウェークローネ	国債証券	9銘柄	100.00%	0.24%
デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	100.00%	0.43%
メキシコペソ	国債証券	13銘柄	100.00%	0.73%
イスラエルシェケル	国債証券	9銘柄	100.00%	0.44%
ポーランドズロチ	国債証券	10銘柄	100.00%	0.46%
中国元	国債証券	17銘柄	100.00%	0.69%
ユーロ	国債証券	265銘柄	100.00%	38.18%

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)	
[令和 4年 2月 7日現在]	
資産の部	
流動資産	
預金	893,050,356
コール・ローン	38,921,020
国債証券	51,613,744,638
派生商品評価勘定	135,966
未収利息	658,306,576
前払費用	77,196,863
流動資産合計	53,281,355,419
資産合計	53,281,355,419
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	39,910
未払金	234,683,569
未払解約金	12,343,627
未払利息	17
流動負債合計	247,067,123
負債合計	247,067,123
純資産の部	
元本等	
元本	37,070,942,582
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	15,963,345,714
元本等合計	53,034,288,296
純資産合計	53,034,288,296
負債純資産合計	53,281,355,419

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）

	[令和 4年 2月 7日現在]
1. 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	27,572,904,493円
期中追加設定元本額	12,058,607,884円
期中一部解約元本額	2,560,569,795円
元本の内訳※	
eMAXIS バランス（8資産均等型）	3,421,046,721円
eMAXIS バランス（波乗り型）	380,627,993円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	967,902,321円
コアバランス	1,292,481円
海外債券セレクション（ラップ向け）	370,303,293円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	11,574,253,609円
つみたて8資産均等バランス	5,167,825,243円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,183,264円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	2,820,745円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	577,237円
ラップ向けインデックスf 新興国債券	1,592,777,320円
eMAXIS 新興国債券インデックス	3,155,816,154円
三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド	9,514,317,444円
新興国債券インデックスファンド（ラップ向け）	1,055,495円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	76,384,175円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	396,552,681円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	301,441,978円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	95,078,519円

	[令和 4年 2月 7日現在]
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	7,863,232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ⅤⅠ（適格機関投資家限定）	31,457,896円
合計	37,070,942,582円
２．受益権の総数	37,070,942,582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 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
１．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
２．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債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。 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。 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。 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。
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。

２ 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 4年 2月 7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

区分	[令和 4年 2月 7日現在]
	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	[令和 4年 2月 7日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	120,779,724
合計	120,779,724

（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

[令和 4年 2月 7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				
	マレーシアリンギット	27,952,284	—	28,088,250	135,966
	ポーランドズロチ	2,891,650	—	2,891,160	△490
	売建				
	メキシコペソ	9,996,300	—	10,035,720	△39,420
合計		40,840,234	—	41,015,130	96,056

（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）

	[令和 4年 2月 7日現在]
1口当たり純資産額	1.4306円
(1万口当たり純資産額)	(14,306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 アリン ギット	国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	9,800,000.00	8,998,452.89	
		3.502MALAYSIAGOV 270531	4,100,000.00	4,123,975.98	
		3.733 MALAYSIAGO 280615	7,350,000.00	7,433,995.06	
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	6,400,000.00	5,993,595.70	
		3.8 MALAYSIAGOV 230817	13,100,000.00	13,392,647.45	
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	9,370,000.00	9,177,393.09	
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	16,050,000.00	16,295,961.43	
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	11,500,000.00	11,785,672.65	
		3.9 MALAYSIAGOV 261130	13,720,000.00	14,095,220.04	
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	20,500,000.00	21,119,924.10	
		4.059 MALAYSIAGOV 240930	9,900,000.00	10,209,692.79	
		4.065 MALAYSIAGOV 500615	7,100,000.00	6,794,154.43	
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	10,450,000.00	10,772,134.83	
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	6,050,000.00	6,175,738.96	
		4.369 MALAYSIA IN 281031	8,600,000.00	9,022,867.15	
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	6,100,000.00	6,617,383.09	
マレーシアリングット合計			160,090,000.00	162,008,809.64 (4,461,560,608)	

タイバーツ	国債証券	0.75 THAILAND 240617	100,800,000.00	100,723,472.64	
		0.95 THAILAND 250617	56,100,000.00	56,003,479.38	
		1 THAILAND 270617	42,900,000.00	41,835,368.28	
		1.45 THAILAND 241217	87,600,000.00	88,957,756.20	
		1.585 THAILAND 351217	48,600,000.00	43,265,739.33	
		1.6 THAILAND 291217	69,500,000.00	67,838,022.17	
		1.6 THAILAND 350617	30,500,000.00	27,280,155.87	
		2 THAILAND 221217	54,300,000.00	55,015,277.61	
		2 THAILAND 311217	36,000,000.00	35,562,555.00	
		2 THAILAND 420617	34,500,000.00	30,007,968.90	
		2.125 THAILAND 261217	84,300,000.00	87,194,128.59	
		2.4 THAILAND 231217	61,600,000.00	63,603,761.76	
		2.875 THAILAND 281217	67,400,000.00	72,166,858.26	
		2.875 THAILAND 460617	57,200,000.00	56,778,472.60	
		3.3 THAILAND 380617	80,100,000.00	85,934,443.95	
		3.4 THAILAND 360617	65,000,000.00	70,849,122.50	
		3.625 THAILAND 230616	47,900,000.00	49,879,347.75	
		3.65 THAILAND 310620	70,100,000.00	79,441,252.61	
		3.775 THAILAND 320625	82,200,000.00	94,128,453.00	
		3.85 THAILAND 251212	81,700,000.00	90,095,900.50	
		4.875 THAILAND 290622	67,300,000.00	80,983,375.43	
タイバーツ合計			1,325,600,000.00	1,377,544,912.33 (4,821,407,193)	
フィリピンペソ	国債証券	6.25 PHILIPPI(GL) 360114	20,000,000.00	22,082,320.00	
フィリピンペソ合計			20,000,000.00	22,082,320.00 (49,777,965)	
インドネシアルピア	国債証券	10.5 INDONESIA 300815	7,050,000,000.00	8,841,405,000.00	
		11 INDONESIA 250915	5,250,000,000.00	6,288,265,725.00	
		5.125 INDONESIA 270415	7,700,000,000.00	7,656,918,500.00	
		5.5 INDONESIA 260415	12,900,000,000.00	13,022,550,000.00	
		5.625 INDONESIA 230515	21,700,000,000.00	22,291,325,000.00	
		6.125 INDONESIA 280515	29,000,000,000.00	29,087,000,000.00	
		6.25 INDONESIA 360615	2,000,000,000.00	1,987,000,000.00	
		6.5 INDONESIA 250615	52,400,000,000.00	54,967,600,000.00	
		6.5 INDONESIA 310215	35,900,000,000.00	35,855,125,000.00	
		6.625 INDONESIA 330515	29,400,000,000.00	29,341,200,000.00	
		7 INDONESIA 270515	23,450,000,000.00	24,950,800,000.00	
		7 INDONESIA 300915	29,700,000,000.00	30,516,750,000.00	
		7.125 INDONESIA 420615	12,800,000,000.00	13,088,384,000.00	
		7.5 INDONESIA 320815	10,900,000,000.00	11,483,150,000.00	
		7.5 INDONESIA 350615	15,300,000,000.00	16,095,600,000.00	
		7.5 INDONESIA 380515	28,200,000,000.00	29,483,100,000.00	

		7.5 INDONESIA 400415	1,500,000,000.00	1,577,250,000.00	
		8.125 INDONESIA 240515	24,600,000,000.00	26,598,750,000.00	
		8.25 INDONESIA 290515	24,500,000,000.00	27,133,750,000.00	
		8.25 INDONESIA 320615	19,000,000,000.00	21,191,650,000.00	
		8.25 INDONESIA 360515	29,200,000,000.00	32,441,200,000.00	
		8.375 INDONESIA 240315	37,100,000,000.00	40,105,100,000.00	
		8.375 INDONESIA 260915	29,930,000,000.00	33,566,495,000.00	
		8.375 INDONESIA 340315	32,700,000,000.00	36,689,400,000.00	
		8.375 INDONESIA 390415	23,200,000,000.00	26,181,200,000.00	
		8.75 INDONESIA 310515	15,400,000,000.00	17,652,250,000.00	
		9 INDONESIA 290315	15,500,000,000.00	17,801,750,000.00	
		9.5 INDONESIA 310715	20,200,000,000.00	24,120,820,000.00	
インドネシアルピア合計			596,480,000,000.00	640,015,788,225.00 (5,120,126,305)	
メキシコ ペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	68,700,000.00	73,016,874.42	
		10 MEXICAN BONOS 361120	17,700,000.00	21,200,840.52	
		5.5 MEXICAN BONOS 270304	5,700,000.00	5,213,790.00	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	119,200,000.00	111,932,422.48	
		6.75 MEXICAN BONO 230309	17,000,000.00	16,937,100.00	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	97,200,000.00	97,066,045.76	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	83,300,000.00	83,995,555.00	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	24,900,000.00	25,022,259.00	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	50,900,000.00	49,523,155.00	
		8 MEXICAN BONOS 231207	63,300,000.00	63,844,842.09	
		8 MEXICAN BONOS 240905	92,000,000.00	93,057,080.00	
		8 MEXICAN BONOS 471107	63,400,000.00	63,280,610.82	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	74,000,000.00	77,966,170.60	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	61,900,000.00	65,302,909.17	
メキシコペソ合計			839,200,000.00	847,359,654.86 (4,725,301,115)	
ブラジル リアル	国債証券	10 (IN)BRAZIL NT 270101	28,270,000.00	27,449,975.50	
		10 (IN)BRAZIL NTN 250101	18,950,000.00	18,708,611.67	
		10 (IN)BRAZIL NTN 310101	8,300,000.00	7,780,200.79	
		10(IN) BRAZIL NTN 290101	16,000,000.00	15,132,223.83	
		10(IN)BRAZIL NTN-F230101	15,400,000.00	15,313,834.38	
		BRAZIL-LTN 230701	53,900,000.00	46,044,060.90	
		BRAZIL-LTN 240101	59,300,000.00	48,265,321.86	
		BRAZIL-LTN 240701	25,200,000.00	19,563,681.54	
ブラジルリアル合計			225,320,000.00	198,257,910.47 (4,289,309,893)	
チリペソ	国債証券	2.3 BONOS TESORER 281001	280,000,000.00	231,854,000.00	
		2.5 BONOS TESORER 250301	1,640,000,000.00	1,513,310,000.00	

		4 BONOS TESORERIA 230301	490,000,000.00	487,476,500.00	
		4.5 BONOS TESORER 260301	1,200,000,000.00	1,176,420,000.00	
		4.7 BONOS TESORER 300901	1,280,000,000.00	1,230,784,000.00	
		5 BONOS TESORERIA 281001	660,000,000.00	650,576,262.00	
		5 BONOS TESORERIA 350301	1,290,000,000.00	1,243,796,650.00	
		6 BONOS TESORERIA 430101	980,000,000.00	1,023,463,000.00	
チリペソ合計			7,820,000,000.00	7,557,680,412.00 (1,052,301,189)	
チェココ ルナ	国債証券	0.05 CZECH REPUB 291129	151,000,000.00	119,743,000.00	
		0.25 CZECH REPUB 270210	147,500,000.00	127,966,560.25	
		0.45 CZECH REPUB 231025	76,500,000.00	72,268,257.91	
		1.5 CZECH REPUBLI 400424	15,500,000.00	11,826,500.00	
		1.75 CZECH REPUB 320623	94,200,000.00	83,555,400.00	
		CZECH REPUBLIC 241212	51,000,000.00	46,264,123.17	
チェココルナ合計			535,700,000.00	461,623,841.33 (2,502,970,630)	
エジプト ポンド	国債証券	13.536 EGYPT GOVE 250114	3,000,000.00	2,952,630.03	
		14.06 EGYPT GOVER 260112	8,000,000.00	7,940,880.56	
		14.369 EGYPT GOVE 251020	10,000,000.00	10,012,504.00	
		14.483 EGYPT GOVE 260406	10,000,000.00	10,041,414.00	
		14.531 EGYPT GOVE 240914	7,000,000.00	7,058,870.00	
		14.556 EGYPT GOVE 271013	10,000,000.00	10,058,704.00	
		14.664 EGYPT GOVE 301006	4,000,000.00	4,038,351.60	
		16.1 EGYPT GOVERN 290507	4,500,000.00	4,825,790.55	
エジプトポンド合計			56,500,000.00	56,929,144.74 (416,914,898)	
コロンビ アペソ	国債証券	10 TITULOS DE TES 240724	7,700,000,000.00	8,132,636,820.00	
		4.375 COLOMBI(GL) 230321	1,680,000,000.00	1,655,472,000.00	
		5.75 TITULOS DE T 271103	4,900,000,000.00	4,316,588,801.00	
		6 TITULOS DE TESO 280428	10,580,000,000.00	9,333,647,328.20	
		6.25 TITULOS DE T 251126	5,690,000,000.00	5,357,859,792.20	
		6.25 TITULOS DE T 360709	4,100,000,000.00	3,229,207,068.00	
		7 TITULOS DE TESO 310326	4,600,000,000.00	4,119,300,000.00	
		7 TITULOS DE TESO 320630	8,800,000,000.00	7,720,041,032.00	
		7.25 TITULOS DE T 341018	8,200,000,000.00	7,175,251,248.00	
		7.25 TITULOS DE T 501026	5,800,000,000.00	4,624,212,864.00	
		7.5 TITULOS DE TE 260826	7,770,000,000.00	7,551,841,554.60	
		7.75 TITULOS DE T 300918	7,360,000,000.00	6,973,625,686.40	
		9.85 COLOMBI (GL) 270628	1,290,000,000.00	1,412,150,100.00	
コロンビアペソ合計			78,470,000,000.00	71,601,834,294.40 (2,085,188,618)	
	国債証券	1.5 HUNGARY 230823	50,000,000.00	48,157,047.50	

ハンガリー フォリント		1.5 HUNGARY 260422	690,000,000.00	611,635,202.70	
		1.5 HUNGARY 260826	160,000,000.00	139,758,560.00	
		2.25 HUNGARY 330420	330,000,000.00	259,637,400.00	
		2.25 HUNGARY 340622	150,000,000.00	114,562,500.00	
		2.5 HUNGARY 241024	390,000,000.00	372,303,360.00	
		2.75 HUNGARY 261222	373,000,000.00	342,264,800.00	
		3 HUNGARY 240626	359,000,000.00	348,750,550.00	
		3 HUNGARY 271027	421,000,000.00	386,110,723.81	
		3 HUNGARY 300821	498,000,000.00	436,263,423.06	
		3 HUNGARY 381027	250,000,000.00	195,287,500.00	
		3 HUNGARY 410425	130,000,000.00	98,436,000.00	
		3.25 HUNGARY 311022	618,000,000.00	542,969,856.00	
		5.5 HUNGARY 250624	492,000,000.00	506,981,400.00	
		6 HUNGARY 231124	303,000,000.00	312,605,100.00	
		6.75 HUNGARY 281022	182,000,000.00	201,774,300.00	
ハンガリーフォリント合計			5,396,000,000.00	4,917,497,723.07 (1,832,815,328)	
ペルーヌ エボソル	国債証券	5.35 PERU 400812	2,600,000.00	2,188,275.09	
		5.4 PERU 340812	3,600,000.00	3,245,840.38	
		5.7 PERU 240812	1,300,000.00	1,343,502.94	
		5.94 PERU 290212	4,700,000.00	4,771,181.50	
		6.15 PERU 320812	5,500,000.00	5,468,468.06	
		6.35 PERU 280812	4,900,000.00	5,107,659.55	
		6.9 PERU 370812	4,700,000.00	4,724,409.92	
		6.95 PERU 310812	5,300,000.00	5,627,328.53	
		8.2 PERU 260812	4,500,000.00	5,102,274.15	
ペルーヌエボソル合計			37,100,000.00	37,578,940.12 (1,126,135,614)	
ポーランド ズロチ	国債証券	0.25 POLAND 261025	10,600,000.00	8,998,340.00	
		0.75 POLAND 250425	8,500,000.00	7,757,947.18	
		1.25 POLAND 301025	8,500,000.00	6,935,751.11	
		2.25 POLAND 241025	11,000,000.00	10,626,002.52	
		2.5 POLAND 230125	9,100,000.00	9,036,810.51	
		2.5 POLAND 240425	10,100,000.00	9,875,787.67	
		2.5 POLAND 260725	14,500,000.00	13,719,881.73	
		2.5 POLAND 270725	10,900,000.00	10,154,758.49	
		2.75 POLAND 280425	11,250,000.00	10,570,500.00	
		2.75 POLAND 291025	16,700,000.00	15,461,695.00	
		3.25 POLAND 250725	12,500,000.00	12,291,242.62	
		4 POLAND 231025	10,000,000.00	10,070,500.00	
		5.75 POLAND 220923	3,200,000.00	3,264,960.00	
					136,850,000.00

ポーランドズロチ合計				(3,723,409,319)	
南アフリ カランド	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	89,200,000.00	99,282,276.00	
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	25,400,000.00	18,129,250.00	
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	27,400,000.00	18,600,490.00	
		7 SOUTH AFRICA 310228	39,500,000.00	33,496,000.00	
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	9,600,000.00	9,848,640.00	
		8 SOUTH AFRICA 300131	84,200,000.00	78,078,660.00	
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	63,900,000.00	57,874,763.56	
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	61,500,000.00	53,077,575.00	
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	52,800,000.00	44,975,040.00	
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	86,700,000.00	73,890,075.00	
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	58,700,000.00	53,293,316.74	
		9 SOUTH AFRICA 400131	37,400,000.00	33,108,350.00	
南アフリカランド合計			636,300,000.00	573,654,436.30 (4,273,725,550)	
ウルグア イペソ	国債証券	8.25 URUGUAY 310521	17,000,000.00	16,391,926.83	
		8.5 URUGUAY(GL) 280315	7,000,000.00	6,972,000.00	
ウルグアイペソ合計			24,000,000.00	23,363,926.83 (61,552,265)	
ロシア ルーブル	国債証券	4.5 RUSSIA OFZ 250716	135,800,000.00	117,005,980.72	
		5.7 RUSSIA OFZ 280517	167,000,000.00	139,037,520.00	
		6 RUSSIA OFZ 271006	126,900,000.00	108,720,610.56	
		6.1 RUSSIA OFZ 350718	132,000,000.00	101,689,500.00	
		6.5 RUSSIA OFZ 240228	120,000,000.00	113,806,800.00	
		6.7 RUSSIA OFZ 290314	85,000,000.00	73,637,200.00	
		6.9 RUSSIA OFZ 290523	118,200,000.00	103,698,042.00	
		6.9 RUSSIA OFZ 310723	130,000,000.00	111,581,600.00	
		7 RUSSIA GOVT 230125	44,500,000.00	43,518,330.00	
		7 RUSSIA GOVT BON 230816	62,000,000.00	59,940,050.00	
		7.05 RUSSIA GOVT 280119	125,700,000.00	113,107,374.00	
		7.1 RUSSIA OFZ 241016	121,400,000.00	115,196,256.04	
		7.15 RUSSIA OFZ 251112	142,500,000.00	133,175,736.22	
		7.25 RUSSIA OFZ 340510	123,300,000.00	106,222,950.00	
		7.4 RUSSIA OFZ 221207	86,700,000.00	85,335,441.70	
		7.4 RUSSIA OFZ 240717	118,000,000.00	113,185,399.40	
		7.65 RUSSIA OFZ 300410	144,000,000.00	130,808,160.00	
		7.7 RUSSIA OFZ 330323	103,700,000.00	93,167,191.00	
		7.7 RUSSIA OFZ 390316	100,800,000.00	88,782,624.00	
		7.75 RUSSIA OFZ 260916	125,600,000.00	118,587,752.00	
		7.95 RUSSIA OFZ 261007	101,100,000.00	96,166,479.73	
		8.15 RUSSIA GOVT 270203	111,000,000.00	106,062,284.88	
		8.5 RUSSIA OFZ 310917	87,700,000.00	84,209,540.00	

ロシアルーブル合計			2,612,900,000.00	2,356,642,822.25 (3,558,530,661)	
中国元	国債証券	1.99 CHINA GOVT 250409	24,000,000.00	23,725,390.08	
		2.36 CHINA GOVT 230702	5,000,000.00	5,015,788.00	
		2.68 CHINA GOVT 300521	18,000,000.00	17,831,008.98	
		2.69 CHINA GOVT 260812	10,000,000.00	10,125,124.00	
		2.84 CHINA GOVT 240408	2,000,000.00	2,026,946.80	
		2.85 CHINA GOVT 270604	16,000,000.00	16,289,764.80	
		2.88 CHINA GOVT 231105	16,000,000.00	16,210,364.80	
		2.94 CHINA GOVT 241017	16,000,000.00	16,277,539.20	
		3.01 CHINA GOVT 280513	12,000,000.00	12,271,546.80	
		3.02 CHINA GOVT 310527	3,000,000.00	3,067,289.10	
		3.03 CHINA GOVT 260311	5,000,000.00	5,118,280.50	
		3.12 CHINA GOVT 261205	5,000,000.00	5,147,600.50	
		3.13 CHINA GOVT 291121	19,000,000.00	19,526,250.60	
		3.19 CHINA GOVT 240411	17,000,000.00	17,358,778.20	
		3.22 CHINA GOVT 251206	22,000,000.00	22,681,861.40	
		3.25 CHINA GOVT 260606	15,200,000.00	15,722,132.16	
		3.25 CHINA GOVT 281122	10,000,000.00	10,381,039.00	
		3.27 CHINA GOVT 301119	8,000,000.00	8,311,421.60	
		3.28 CHINA GOVT 271203	15,000,000.00	15,618,877.50	
		3.29 CHINA GOVT 231018	4,000,000.00	4,076,584.80	
		3.29 CHINA GOVT 290523	17,000,000.00	17,687,350.80	
		3.53 CHINA GOVT 511018	1,000,000.00	1,045,511.20	
		3.72 CHINA GOVT 510412	5,000,000.00	5,363,078.00	
		3.81 CHINA GOVT 500914	15,000,000.00	16,257,511.50	
中国元合計			280,200,000.00	287,137,040.32 (5,204,416,283)	
ドミニカ ペソ	国債証券	8.9 DOMINICAN 230215	8,000,000.00	8,244,000.00	
		9.75 DOMINICAN 260605	16,000,000.00	17,080,000.00	
ドミニカペソ合計			24,000,000.00	25,324,000.00 (50,650,532)	
セルビア ディナール	国債証券	4.5 SERBIA TREASU 260111	46,000,000.00	48,301,205.20	
		4.5 SERBIA TREASU 320820	47,000,000.00	49,927,799.20	
		5.875 SERBIA TREA 280208	35,000,000.00	39,461,509.50	
セルビアディナール合計			128,000,000.00	137,690,513.90 (154,506,931)	
ルーマニ アレイ	国債証券	3.25 ROMANIA GOVE 240429	4,400,000.00	4,276,800.00	
		3.25 ROMANIA GOVE 260624	3,200,000.00	2,994,354.36	
		3.65 ROMANIA GOVE 310924	4,300,000.00	3,716,683.50	
		3.7 ROMANIA GOVER 241125	2,600,000.00	2,537,526.39	
		4.15 ROMANIA GOVE 280126	1,700,000.00	1,624,772.72	

		4.15 ROMANIA GOVE 301024	3,000,000.00	2,751,278.04	
		4.25 ROMANIA GOVE 230628	4,200,000.00	4,193,595.00	
		4.5 ROMANIA GOVER 240617	9,200,000.00	9,175,804.00	
		4.75 ROMANIA GOVE 250224	6,900,000.00	6,893,962.50	
		4.75 ROMANIA GOVE 341011	1,700,000.00	1,571,384.80	
		4.85 ROMANIA GOVE 260422	4,900,000.00	4,880,914.50	
		5 ROMANIA GOVERN 290212	3,960,000.00	3,912,183.00	
		5.8 ROMANIA GOV 270726	6,800,000.00	7,039,088.00	
		5.85 ROMANIA GOVE 230426	4,500,000.00	4,582,350.00	
ルーマニアレイ合計			61,360,000.00	60,150,696.81 (1,605,500,293)	
トルコリ ラ	国債証券	10.4 TURKEY GOVT 240320	2,400,000.00	2,014,800.00	
		10.5 TURKEY GOVT 270811	5,200,000.00	3,286,400.00	
		10.6 TURKEY GOVT 260211	9,600,000.00	6,806,400.00	
		11 TURKEY GOVT 270224	4,500,000.00	3,001,500.00	
		11.7 TURKEY GOVT 301113	11,800,000.00	7,257,000.00	
		12.2 TURKEY GOVT 230118	5,600,000.00	5,345,200.00	
		12.4 TURKEY GOVT 280308	4,100,000.00	2,837,200.00	
		12.6 TURKEY GOVT 251001	8,600,000.00	6,673,600.00	
		16.2 TURKEY GOVT 230614	1,300,000.00	1,264,900.00	
		7.1 TURKEY GOVT 230308	3,400,000.00	3,041,300.00	
		8 TURKEY GOVT 250312	7,300,000.00	5,197,600.00	
		8.5 TURKEY GOVT 220914	3,400,000.00	3,258,900.00	
		9 TURKEY GOVT 240724	11,000,000.00	8,508,500.00	
トルコリラ合計			78,200,000.00	58,493,300.00 (497,643,448)	
合計				51,613,744,638 (51,613,744,638)	

(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 16銘柄	100.00%	8.64%
タイバーツ	国債証券 21銘柄	100.00%	9.34%
フィリピンペソ	国債証券 1銘柄	100.00%	0.10%
インドネシアルピア	国債証券 28銘柄	100.00%	9.92%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.00%	9.16%
ブラジルリアル	国債証券 8銘柄	100.00%	8.31%
チリペソ	国債証券 8銘柄	100.00%	2.04%

チェココルナ	国債証券	6銘柄	100.00%	4.85%
エジプトポンド	国債証券	8銘柄	100.00%	0.81%
コロンビアペソ	国債証券	13銘柄	100.00%	4.04%
ハンガリーフォリント	国債証券	16銘柄	100.00%	3.55%
ペルーヌエボソル	国債証券	9銘柄	100.00%	2.18%
ポーランドズロチ	国債証券	13銘柄	100.00%	7.21%
南アフリカランド	国債証券	12銘柄	100.00%	8.28%
ウルグアイペソ	国債証券	2銘柄	100.00%	0.12%
ロシアルーブル	国債証券	23銘柄	100.00%	6.89%
中国元	国債証券	24銘柄	100.00%	10.08%
ドミニカペソ	国債証券	2銘柄	100.00%	0.10%
セルビアディナール	国債証券	3銘柄	100.00%	0.30%
ルーマニアレイ	国債証券	14銘柄	100.00%	3.11%
トルコリラ	国債証券	13銘柄	100.00%	0.96%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（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】

【海外債券セレクション（ラップ向け）】

【純資産額計算書】

令和 4年 2月28日現在

(単位：円)

I 資産総額	13,769,424,750
II 負債総額	19,408,434
III 純資産総額（I－II）	13,750,016,316
IV 発行済口数	11,827,976,632口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	1.1625
(10,000口当たり)	(11,625)

(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

令和 4年 2月28日現在

(単位：円)

I 資産総額	292,067,131,543
II 負債総額	349,520,936
III 純資産総額（I－II）	291,717,610,607
IV 発行済口数	129,718,206,840口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	2.2489
(10,000口当たり)	(22,489)

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

令和 4年 2月28日現在

(単位：円)

I 資産総額	51,832,200,164
II 負債総額	42,282,157
III 純資産総額（I－II）	51,789,918,007
IV 発行済口数	37,027,854,637口

V 1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3987
（10,000口当たり）	（13,987）

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、信託約款の規定のほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（1）資本金の額等

2022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年間における資本金の額の増減はありません。

（2）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

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

・投資運用の意思決定機構

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投資行動のモニタリング1

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

⑥投資行動のモニタリング2

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

⑦ファンドに関係する法人等の管理

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

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。

2022年 2月28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	899	18,862,930
追加型公社債投資信託	16	1,349,427
単位型株式投資信託	89	407,755
単位型公社債投資信託	50	182,673
合 計	1,054	20,802,785

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

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

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

（2）監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第36期事業年度（自 令和2年4月1日 至 令和3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37期事業年度に係る中間会計期間（自 令和3年4月1日 至 令和3年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

(単位：千円)

第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
-----------------------	-----------------------

(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	※2	56,398,457	※2	56,803,388
有価証券		1,960,318		2,001
前払費用		575,904		598,135
未収入金		14,559		31,359
未収委託者報酬		10,296,453		13,216,357
未収収益	※2	638,994	※2	662,230
金銭の信託		100,000		2,300,000
その他		254,330		269,506
流動資産合計		70,239,017		73,882,978
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	584,048	※1	548,902
器具備品	※1	871,893	※1	1,435,369
土地		628,433		628,433
有形固定資産合計		2,084,375		2,612,705
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		3,369,611		3,569,171
ソフトウェア仮勘定		1,374,932		1,895,190
無形固定資産合計		4,760,365		5,480,184
投資その他の資産				
投資有価証券		16,704,756		18,616,670
関係会社株式		320,136		320,136
投資不動産	※1	819,255	※1	814,684
長期差入保証金		565,358		538,497
前払年金費用		375,031		258,835
繰延税金資産		1,912,824		916,962
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		20,718,993		21,487,417
固定資産合計		27,563,734		29,580,307
資産合計		97,802,752		103,463,286

(単位：千円)

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	687,565	533,622
未払金		
未払収益分配金	131,478	158,856
未払償還金	395,400	133,877
未払手数料	※2 4,026,078	※2 5,200,810
その他未払金	※2 3,818,195	※2 4,412,521
未払費用	※2 4,402,578	※2 4,755,909
未払消費税等	629,469	752,617
未払法人税等	617,341	873,027

賞与引当金	933,517	933,381
役員賞与引当金	124,590	160,710
その他	701,285	691,143
流動負債合計	16,467,499	18,606,476
固定負債		
長期未払金	32,400	21,600
退職給付引当金	1,010,401	1,145,514
役員退職慰労引当金	130,784	117,938
時効後支払損引当金	238,811	245,426
固定負債合計	1,412,398	1,530,479
負債合計	17,879,897	20,136,956
(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	25,847,605	26,951,289
利益剰余金合計	33,188,194	34,291,879
株主資本合計	79,921,039	81,024,723

(単位：千円)

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3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	1,815	2,301,606
評価・換算差額等合計	1,815	2,301,606
純資産合計	79,922,854	83,326,329
負債純資産合計	97,802,752	103,463,286

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	67,967,489	67,963,712
投資顧問料	2,385,084	2,443,980
その他営業収益	16,085	21,613
営業収益合計	70,368,658	70,429,306
営業費用		

支払手数料	※2	27,106,451	※2	26,689,896
広告宣伝費		696,418		668,150
公告費		1,000		250
調査費				
調査費		1,857,271		2,077,942
委託調査費		11,579,175		12,035,954
事務委託費		847,769		798,528
営業雑経費				
通信費		153,731		296,490
印刷費		427,118		378,180
協会費		52,053		51,841
諸会費		15,990		16,613
事務機器関連費		1,953,926		1,977,769
その他営業雑経費		-		8,391
営業費用合計		44,690,907		45,000,009
一般管理費				
給料				
役員報酬		331,987		352,879
給料・手当		6,611,427		6,461,546
賞与引当金繰入		933,517		933,381
役員賞与引当金繰入		124,590		160,710
福利厚生費		1,276,950		1,272,568
交際費		11,871		2,721
旅費交通費		165,891		22,768
租税公課		360,165		402,939
不動産賃借料		647,402		666,331
退職給付費用		422,919		481,135
役員退職慰労引当金繰入		48,183		11,763
固定資産減価償却費		1,307,555		1,358,911
諸経費		427,212		413,538
一般管理費合計		12,669,674		12,541,193
営業利益		13,008,076		12,888,103

(単位：千円)

		第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)		第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
営業外収益				
受取配当金		90,965		170,807
受取利息	※2	4,169	※2	2,726
投資有価証券償還益		585,179		81,557
収益分配金等時効完成分		101,734		275,835
受取賃貸料	※2	65,808	※2	65,808
その他		19,987		12,504
営業外収益合計		867,845		609,239
営業外費用				
投資有価証券償還損		96,379		95,946
時効後支払損引当金繰入		-		16,395
事務過誤費		3,483		-
賃貸関連費用		20,339		13,472
その他		1,920		2,932

営業外費用合計		122,122		128,747
経常利益		13,753,799		13,368,595
特別利益				
投資有価証券売却益		174,842		2,007,655
特別利益合計		174,842		2,007,655
特別損失				
投資有価証券売却損		75,963		51,737
投資有価証券評価損		163,865		26,317
固定資産除却損	※1	8,832	※1	536
固定資産売却損		435		-
特別損失合計		249,096		78,591
税引前当期純利益		13,679,545		15,297,659
法人税、住民税及び事業税	※2	4,146,534	※2	4,755,427
法人税等調整額		79,824		△19,122
法人税等合計		4,226,359		4,736,304
当期純利益		9,453,186		10,561,354

(3) 【株主資本等変動計算書】

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	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	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,069,594	33,410,184	80,143,028
当期変動額									
剰余金の配当							△9,675,175	△9,675,175	△9,675,175
当期純利益							9,453,186	9,453,186	9,453,186
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	—	—	—	—	—	—	△221,989	△221,989	△221,989
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	25,847,605	33,188,194	79,921,039

	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	1,126,733	1,126,733	81,269,762
当期変動額			
剰余金の配当			△9,675,175
当期純利益			9,453,186
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△1,124,917	△1,124,917	△1,124,917
当期変動額合計	△1,124,917	△1,124,917	△1,346,907
当期末残高	1,815	1,815	79,922,854

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	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	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	25,847,605	33,188,194	79,921,039
当期変動額									
剰余金の配当							△9,457,670	△9,457,670	△9,457,670
当期純利益							10,561,354	10,561,354	10,561,354
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)									
当期変動額合計	—	—	—	—	—	—	1,103,684	1,103,684	1,103,684
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,951,289	34,291,879	81,024,723

	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	1,815	1,815	79,922,854
当期変動額			
剰余金の配当			△9,457,670
当期純利益			10,561,354
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	2,299,791	2,299,791	2,299,791
当期変動額合計	2,299,791	2,299,791	3,403,475
当期末残高	2,301,606	2,301,606	83,326,329

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 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、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに平成28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～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.その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(1)消費税等の会計処理

税抜方式を採用しており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

(2)連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(3)「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」の適用

令和2年度税制改正において従来の連結納税制度が見直され、グループ通算制度に移行する税制改正法（「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号））が令和2年3月31日に公布されておりますが、繰延税金資産の額について、実務対応報告第39号「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」により企業会計基準適用指針第28号「税効果会計に係る会計基準の適用指針」第44項の定めを適用せず、改正前の税法の規定に基づいて算定しております。

(未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）

(1)概要

国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、平成26年5月に「顧客との契約から生じる収益」（IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic606）を公表しており、IFRS第15号は平成30年1月1日以後開始する事業年度から、Topic606は平成29年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわせない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

(2)適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

(3)当該会計基準等の適用による影響

「収益認識に関する会計基準」等の適用により、翌事業年度の期首の純資産に累積的影響額が反映され、繰越利益剰余金の期首残高が475,687千円増加すると見込まれます。

- ・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「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 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）

(1)概要

国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス（国際財務報告基準（IFRS）においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」）を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされております。

(2)適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

(3)当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

(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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
建物	599,542千円	643,920千円
器具備品	1,408,613千円	1,545,179千円
投資不動産	145,391千円	151,833千円

※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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
預金	314,247千円	40,328,414千円
未収収益	15,773千円	14,138千円
未払手数料	712,210千円	772,495千円
その他未払金	3,029,426千円	3,425,136千円
未払費用	432,019千円	349,222千円

(損益計算書関係)

※1.固定資産除却損の内訳

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)

器具備品	8,832千円	536千円
計	8,832千円	536千円

※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35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
支払手数料	5,234,629千円	5,128,270千円
受取利息	2千円	143千円
受取賃貸料	65,808千円	65,808千円
法人税、住民税及び事業税	3,030,180千円	3,492,898千円

(株主資本等変動計算書関係)

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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

令和元年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

- | | | |
|---|----------|-------------|
| ① | 配当金の総額 | 9,675,175千円 |
| ② | 1株当たり配当額 | 45,728円 |
| ③ | 基準日 | 平成31年3月31日 |
| ④ | 効力発生日 | 令和元年6月27日 |

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

令和2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

- | | | |
|---|----------|-------------|
| ① | 配当金の総額 | 9,457,670千円 |
| ② | 配当の原資 | 利益剰余金 |
| ③ | 1株当たり配当額 | 44,700円 |
| ④ | 基準日 | 令和2年3月31日 |
| ⑤ | 効力発生日 | 令和2年6月29日 |

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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

令和2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

- | | | |
|---|----------|-------------|
| ① | 配当金の総額 | 9,457,670千円 |
| ② | 1株当たり配当額 | 44,700円 |
| ③ | 基準日 | 令和2年3月31日 |
| ④ | 効力発生日 | 令和2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

令和3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	配当の原資	利益剰余金
③	1株当たり配当額	49,988円
④	基準日	令和3年3月31日
⑤	効力発生日	令和3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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
1年内	675,956千円	709,808千円
1年超	—	709,808千円
合計	675,956千円	1,419,616千円

(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。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2.金融商品の時価等に関する事項

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

第35期(令和2年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 現金及び預金	56,398,457	56,398,457	—
(2) 有価証券	1,960,318	1,960,318	—
(3) 金銭の信託	100,000	100,000	—
(4) 未収委託者報酬	10,296,453	10,296,453	—
(5) 投資有価証券	16,673,396	16,673,396	—
資産計	85,428,625	85,428,625	—
(1) 未払手数料	4,026,078	4,026,078	—
負債計	4,026,078	4,026,078	—

第36期(令和3年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 現金及び預金	56,803,388	56,803,388	—
(2) 有価証券	2,001	2,001	—
(3) 金銭の信託	2,300,000	2,300,000	—
(4) 未収委託者報酬	13,216,357	13,216,357	—
(5) 投資有価証券	18,585,310	18,585,310	—

資産計	90,907,057	90,907,057	—
(1) 未払手数料	5,200,810	5,200,810	—
負債計	5,200,810	5,200,810	—

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資 産

(1)現金及び預金、(4)未収委託者報酬

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

(2)有価証券、(5)投資有価証券

これらはすべて投資信託であり、時価は基準価額によっております。

(3)金銭の信託

時価は取引金融機関から提示された価格によっております。

負 債

(1)未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
非上場株式	31,360	31,360
子会社株式	160,600	160,600
関連会社株式	159,536	159,536

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第35期(令和2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	56,398,457	—	—	—
金銭の信託	100,000	—	—	—
未収委託者報酬	10,296,453	—	—	—
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	1,960,318	5,652,257	4,813,929	27,375
合計	68,755,228	5,652,257	4,813,929	27,375

第36期(令和3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	56,803,388	—	—	—
金銭の信託	2,300,000	—	—	—
未収委託者報酬	13,216,357	—	—	—
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	2,001	8,412,286	3,123,026	11,398

合計	72,321,747	8,412,286	3,123,026	11,398
----	------------	-----------	-----------	--------

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第35期(令和2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	9,859,345	8,694,010	1,165,334
	小計	9,859,345	8,694,010	1,165,334
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	8,874,369	10,037,087	△1,162,718
	小計	8,874,369	10,037,087	△1,162,718
合計		18,733,714	18,731,098	2,616

(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100,000千円）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、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、含めておりません。

第36期(令和3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	14,810,957	11,362,471	3,448,485
	小計	14,810,957	11,362,471	3,448,485
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	6,076,354	6,207,447	△131,093
	小計	6,076,354	6,207,447	△131,093
合計		20,887,311	17,569,919	3,317,392

(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2,300,000千円）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、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、含めておりません。

3. 売却したその他有価証券

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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	8,940	—	15,060
債券	—	—	—
その他	2,035,469	174,842	60,903
合計	2,044,409	174,842	75,963

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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	5,747,529	2,007,655	51,737
合計	5,747,529	2,007,655	51,737

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163,865千円（その他有価証券のその他163,865千円）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26,317千円（その他有価証券のその他26,317千円）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35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,712,289 千円	3,718,736 千円
勤務費用	204,225	203,106
利息費用	17,557	19,110
数理計算上の差異の 発生額	△52,430	△18,826
退職給付の支払額	△162,904	△192,890
過去勤務費用の発生額	—	—
退職給付債務の期末残高	3,718,736	3,729,235

（2）年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
年金資産の期首残高	2,666,937 千円	2,460,824 千円
期待運用収益	47,757	44,130
数理計算上の差異の 発生額	△164,633	304,281
事業主からの拠出額	51,282	—
退職給付の支払額	△140,518	△159,390
年金資産の期末残高	2,460,824	2,649,846

（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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
積立型制度の 退職給付債務	2,969,807 千円	2,810,893 千円
年金資産	△2,460,824	△2,649,846
	508,982	161,046
非積立型制度の退職給付債務	748,929	918,342
未積立退職給付債務	1,257,911	1,079,388

未認識数理計算上の差異	△203,136	161,333
未認識過去勤務費用	△419,405	△354,043
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635,370	886,678
退職給付引当金	1,010,401	1,145,514
前払年金費用	△375,031	△258,835
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635,370	886,678

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
勤務費用	204,225 千円	203,106 千円
利息費用	17,557	19,110
期待運用収益	△47,757	△44,130
数理計算上の差異の 費用処理額	24,035	41,361
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	6,427	44,446
確定給付制度に係る 退職給付費用	269,848	329,255

(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、再就職支援金及び退職金です。

(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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
債券	64.7 %	62.7 %
株式	32.3	35.4
その他	3.0	1.9
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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
割引率	0.095～0.52%	0.051～0.59%
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153,070千円、当事業年度151,880千円であります。

(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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
繰延税金資産		

減損損失	427,046千円	418,394千円
投資有価証券評価損	226,322	188,859
未払事業税	117,461	180,263
賞与引当金	285,842	285,801
役員賞与引当金	19,703	25,472
役員退職慰労引当金	40,046	36,112
退職給付引当金	309,384	350,756
減価償却超過額	96,767	68,024
委託者報酬	213,044	209,938
長期差入保証金	40,180	48,639
時効後支払損引当金	73,124	75,149
連結納税適用による時価評価	57,656	38,873
その他	123,248	87,023
繰延税金資産 小計	2,029,829	2,013,308
評価性引当額	—	—
繰延税金資産 合計	2,029,829	2,013,308
繰延税金負債		
前払年金費用	△114,834	△79,225
連結納税適用による時価評価	△1,260	△1,203
その他有価証券評価差額金	△801	△1,015,785
その他	△109	△101
繰延税金負債 合計	△117,005	△1,096,346
繰延税金資産の純額	1,912,824	916,962

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35期（令和2年3月31日現在）及び第36期（令和3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。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）及び第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）及び第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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4)	科目	期末残高 (注4)
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)	3,030,180 千円	その他未払金	3,029,426 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)	5,234,629 千円	未払手数料	712,210 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 (注3)	583,270 千円	未払費用	302,681 千円

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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4)	科目	期末残高 (注4)
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)	3,492,898 千円	その他未払金	3,425,136 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)	5,128,270 千円	未払手数料	772,495 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 (注3)	523,327 千円	未払費用	290,120 千円

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. 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35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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3)	科目	期末残高 (注3)
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)	4,073,855 千円	未払手数料	697,109 千円
							取引銀行 コーラブル預金の払戻 (注2)	20,000,000 千円		
							コーラブル預金の預入 (注2)	20,000,000 千円	現金及び預金	20,000,000 千円
							コーラブル預金に係る受取利息 (注2)	4,126 千円	未収収益	997 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)	5,714,501 千円	未払手数料	944,351 千円

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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3)	科目	期末残高 (注3)
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)	3,729,785 千円	未払手数料	764,501 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)	5,655,482 千円	未払手数料	1,193,245 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. 預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は1年であります。
3. 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35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
1株当たり純資産額	377,741.17円	393,827.09円
1株当たり当期純利益金額	44,678.80円	49,916.36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35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
当期純利益金額（千円）	9,453,186	10,561,354
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）	9,453,186	10,561,354
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37期中間会計期間 (令和3年9月30日現在)		
(資産の部)		
流動資産		
現金及び預金		48,742,270
有価証券		1,291,000
前払費用		682,143
未収入金		166,605
未収委託者報酬		15,228,560
未収収益		694,402
金銭の信託		5,301,000
その他		226,759
流動資産合計		72,332,741
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1	527,772
器具備品	※1	1,371,778
土地		628,433
有形固定資産合計		2,527,984
無形固定資産		
電話加入権		15,822
ソフトウェア		4,217,271
ソフトウェア仮勘定		1,478,970
無形固定資産合計		5,712,064
投資その他の資産		

投資有価証券		14,943,458
関係会社株式		320,136
投資不動産	※1	813,041
長期差入保証金		531,230
前払年金費用		224,272
繰延税金資産		733,199
その他		45,230
貸倒引当金		△23,600
投資その他の資産合計		17,586,969
固定資産合計		25,827,017
資産合計		98,159,759

(単位：千円)

第37期中間会計期間
(令和3年9月30日現在)

(負債の部)		
流動負債		
預り金		663,405
未払金		
未払収益分配金		187,200
未払償還金		7,418
未払手数料		6,029,978
その他未払金		2,623,176
未払費用		5,348,002
未払消費税等	※2	757,223
未払法人税等		702,806
賞与引当金		924,214
役員賞与引当金		65,985
その他		5,517
流動負債合計		17,314,927
固定負債		
長期未払金		10,800
退職給付引当金		1,204,214
役員退職慰労引当金		117,938
時効後支払損引当金		256,262
固定負債合計		1,589,215
負債合計		18,904,143
(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		23,330,110
利益剰余金合計		30,670,700
株主資本合計		77,403,544

(単位：千円)

第37期中間会計期間

(令和3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	1,852,071
評価・換算差額等合計	1,852,071
純資産合計	79,255,616
負債純資産合計	98,159,759

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第37期中間会計期間

(自 令和3年4月1日

至 令和3年9月30日)

営業収益	
委託者報酬	39,061,243
投資顧問料	1,319,230
その他営業収益	7,249
営業収益合計	40,387,723
営業費用	
支払手数料	15,372,436
広告宣伝費	277,284
公告費	250
調査費	
調査費	1,187,915
委託調査費	7,042,637
事務委託費	653,911
営業雑経費	
通信費	75,781
印刷費	194,857
協会費	25,068
諸会費	9,036
事務機器関連費	1,066,190
その他営業雑経費	649
営業費用合計	25,906,022
一般管理費	
給料	
役員報酬	202,454
給料・手当	2,828,313
賞与引当金繰入	924,214
役員賞与引当金繰入	65,985
福利厚生費	637,293
交際費	2,635
旅費交通費	12,678
租税公課	232,446
不動産賃借料	364,289
退職給付費用	195,737
固定資産減価償却費	※1 969,675
諸経費	193,083
一般管理費合計	6,628,807
営業利益	7,852,893

(単位：千円)

第37期中間会計期間

(自 令和3年4月1日

至 令和3年9月30日)

営業外収益	
受取配当金	203,195
受取利息	2,567
投資有価証券償還益	753,216
収益分配金等時効完成分	136,491
受取賃貸料	32,904
その他	4,621
営業外収益合計	1,132,996
営業外費用	
投資有価証券償還損	62
時効後支払損引当金繰入	21,921
事務過誤費	66,316
賃貸関連費用	※1 7,921
その他	7,123
営業外費用合計	103,345
経常利益	8,882,544
特別利益	
投資有価証券売却益	522,323
特別利益合計	522,323
特別損失	
投資有価証券売却損	8,073
投資有価証券評価損	36,558
固定資産除却損	7,408
特別損失合計	52,039
税引前中間純利益	9,352,828
法人税、住民税及び事業税	2,700,962
法人税等調整額	172,220
法人税等合計	2,873,183
中間純利益	6,479,644

(3)中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間（自 令和3年4月1日 至 令和3年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	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	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	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	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	27,426,976	34,767,566	81,500,410
当中間期変動額									
剰余金の配当							△10,576,511	△10,576,511	△10,576,511
中間純利益							6,479,644	6,479,644	6,479,644
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	—	—	—	—	—	—	△3,621,178	△3,621,178	△3,621,178
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	23,330,110	30,670,700	77,403,544

	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
当中間期変動額			
剰余金の配当			△10,576,511
中間純利益			6,479,644
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△449,534	△449,534	△449,534
当中間期変動額合計	△449,534	△449,534	△4,070,713
当中間期末残高	1,852,071	1,852,071	79,255,616

[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、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに平成28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～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. 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。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。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

(1) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(2) 「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」の適用

令和2年度税制改正において従来の連結納税制度が見直され、グループ通算制度に移行する税制改正法（「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号））が令和2年3月31日に公布されておりますが、繰延税金資産の額について、実務対応報告第39号「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」により企業会計基準適用指針第28号「税効果会計に係る会計基準の適用指針」第44項の定めを適用せず、改正前の税法の規定に基づいて算定しております。

[会計方針の変更]

(収益認識に関する会計基準等の適用)

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 令和2年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することといたしました。収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当中間会計期間の期首の繰越利益剰余金に加減し、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。

この結果、収益認識会計基準等の適用を行う前と比べて、当中間会計期間の中間貸借対照表は、流動負債のその他は588,191千円減少、繰延税金資産は180,104千円減少、繰越利益剰余金は408,087千円増加しております。

当中間会計期間の中間損益計算書は、委託者報酬、営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ97,433千円減少しております。

当中間会計期間の期首の純資産に累積的影響額が反映されたことにより、中間株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の期首残高は475,687千円増加しております。

1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

(時価の算定に関する会計基準等の適用)

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 令和元年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準（企業会計基準第10号 令和元年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等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、時価算定会計基準等の適用による、中間財務諸表への影響はありません。また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うことといたしました。

[注記事項]

（中間貸借対照表関係）

※1 減価償却累計額

	第37期中間会計期間 (令和3年9月30日現在)
建物	661,109千円
器具備品	1,743,773千円
投資不動産	154,845千円

※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37期中間会計期間 (自 令和3年4月1日 至 令和3年9月30日)
有形固定資産	241,452千円
無形固定資産	728,222千円
投資不動産	3,012千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第37期中間会計期間（自 令和3年4月1日 至 令和3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

令和3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	配当の原資	利益剰余金
③	1株当たり配当額	49,988円
④	基準日	令和3年3月31日
⑤	効力発生日	令和3年6月29日

（リース取引関係）

第37期中間会計期間(令和3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 709,808千円

1年超	354,904千円
合 計	1,064,712千円

（金融商品関係）

第37期中間会計期間（令和3年9月30日現在）

1.金融商品の時価等に関する事項

令和3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	1,291,000	1,291,000	—
(2) 金銭の信託	5,301,000	5,301,000	—
(3) 投資有価証券	14,912,098	14,912,098	—
資産計	21,504,098	21,504,098	—

（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（中間貸借対照表計上額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、子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）は、市場価格がないため、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。

なお、中間財務諸表等規則附則（令和3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（中間貸借対照表計上額 有価証券 1,291,000千円、投資有価証券14,912,098千円）は、次表には含めておりません。

時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

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	—	5,301,000	—	5,301,000
資産計	—	5,301,000	—	5,301,000

（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。

（有価証券関係）

第37期中間会計期間（令和3年9月30日現在）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）は、市場価格がないため、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	18,010,889	15,246,038	2,764,851
	小 計	18,010,889	15,246,038	2,764,851
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	3,493,209	3,588,600	△95,390
	小 計	3,493,209	3,588,600	△95,390
合 計		21,504,098	18,834,638	2,669,460

（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5,301,000千円、取得価額5,300,000千円）を含めております。
非上場株式（中間貸借対照表計上額31,360千円）については、市場価格がないため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

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。

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。

（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37期中間会計期間（自 令和3年4月1日 至 令和3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37期中間会計期間（自 令和3年4月1日 至 令和3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37期中間会計期間 (令和3年9月30日現在)
1株当たり純資産額 (算定上の基礎)	374,587.58円
純資産の部の合計額（千円）	79,255,616
普通株式に係る中間期末の純資産額（千円）	79,255,616
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37期中間会計期間 (自 令和3年4月1日 至 令和3年9月30日)
1株当たり中間純利益金額 (算定上の基礎)	30,624.88円
中間純利益金額（千円）	6,479,644
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）	6,479,644
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581

(注1)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。

(注2)「会計方針の変更」に記載のとおり、「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 令和2年3月31日）等を適用し、「収益認識に関する会計基準」第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当中間会計期間の1株当たり純資産額は2,248.25円増加し、1株当たり中間純利益金額は319.49円減少しております。

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通常の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。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（1）受託会社

①名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

（再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）

②資本金の額：324,279百万円（2021年9月末現在）

③事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

（2）販売会社

①名称	②資本金の額 (2021年9月末現在)	③事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

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

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

3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2022年2月末現在）

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%（211,581株）を所有しています。

（注）関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2021年 4月30日	有価証券届出書
2021年 4月30日	有価証券報告書
2021年11月 4日	有価証券届出書の訂正届出書
2021年11月 4日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

令和3年6月28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 印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊藤 鉄 也 印

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令和2年4月1日から令和3年3月31日までの第36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令和3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。

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

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

令和4年3月16日

三菱UFJ国際投信株式会社
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 和田 渉
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レクション（ラップ向け）の令和3年2月6日から令和4年2月7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、海外債券セレクション（ラップ向け）の令和4年2月7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国際投信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。

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

令和3年12月3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	青木裕晃印
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊藤鉄也印
--------------------	-------	-------

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国際投信株式会社の令和3年4月1日から令和4年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（令和3年4月1日から令和3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国際投信株式会社の令和3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（令和3年4月1日から令和3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

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

以 上

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