

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年10月18日提出
【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
【電話番号】	03-6250-4740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	１兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2022年4月15日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について有価証券報告書の提出に伴う関係情報の更新等を行うため、本訂正届出書を提出します。

2 【訂正の内容】

＜訂正前＞および＜訂正後＞に記載している下線部__は訂正部分を示し、＜更新後＞に記載している内容は原届出書の更新後の内容を示します。

なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンド状況 5 運用状況」、「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載します。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

当ファンドは、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに概ね連動することを目指して運用を行います。

信託金の限度額は、3,000億円です。

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

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

商品分類表

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ()	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
	年２回					
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ()	年４回	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	条件付運用型
	年６回					
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (債券 一般 クレジット属性 (高格付債)))	年１２回 (隔月)				その他 (FTSE世界 国債インデックス (除く日本、 円換算ベース))	ロング・ ショート型／ 絶対収益 追求型
	年１２回 (毎月)					
資産複合 ()	日々					その他 ()
	その他 ()					

※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。
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	特殊型	信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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

属性区分の定義

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

債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
	公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（BBB格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（BBB格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。
決算頻度	年1回	信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年2回	信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年4回	信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年6回（隔月）	信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年12回（毎月）	信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

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

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

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

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

ファンドの特色

特色

1

日本を除く世界各国の公社債を実質的な主要投資対象とします。

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

特色

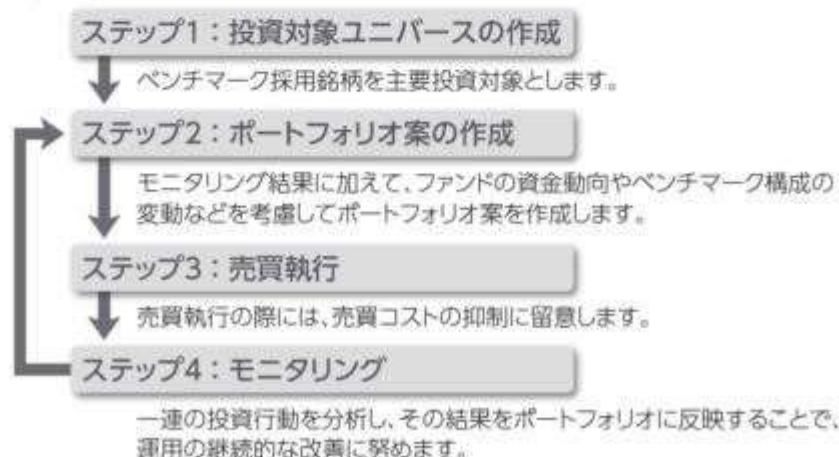
2

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)の動きに概ね連動することをめざして運用を行います。

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。

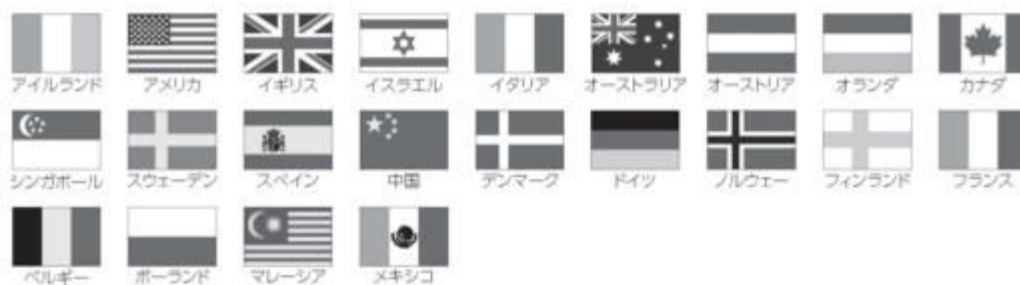
- ベンチマークとは、ファンドの運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指標です。
- FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)は、FTSE世界国債インデックス(除く日本)・データに基づき当社が計算したものです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、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。

<運用プロセスのイメージ>



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

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



ファンドが連動をめざす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、したがってファンドは日本を除く世界各国の公社債の中から投資適格債を実質的な主要投資対象として運用を行います。

当該指数は、22カ国で構成されています(2022年7月末現在、国名は50音順)。ただし、構成国は変わる可能性があります。

長期信用格付け														
投資適格格付け													投機的格付け	
Moody's	Aaa	Aa1	Aa2	Aa3	A1	A2	A3	Baa1	Baa2	Baa3	Ba	B	Caa	Ca
S&P	AAA	AA+	AA	AA-	A+	A	A-	BBB+	BBB	BBB-	BB	B	CCC	CC
													C	D

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

なお、ムーディーズ・インベスターズ・サービス(Moody's)のBaからCaaまでの格付けには「1, 2, 3」、S&Pグローバル・レーティング(S&P)のBBからCCCまでの格付けには「+、-」という付加記号を省略して表示しています。

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。
ただし、市況動向[※]の判断により、為替ヘッジを行う場合があります。

※市況動向とは、天災地変・テロ・戦争等による市場の急変時等を想定しています。

特色4

組入れ国債等の利子・配当収益を中心に、原則として毎月分配を行う方針です。

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

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

収益分配金に関する留意事項

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

投資信託から分配金が
支払われるイメージ



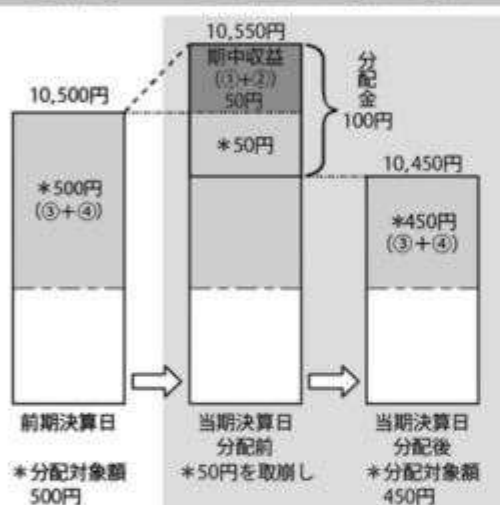
- ◆分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。

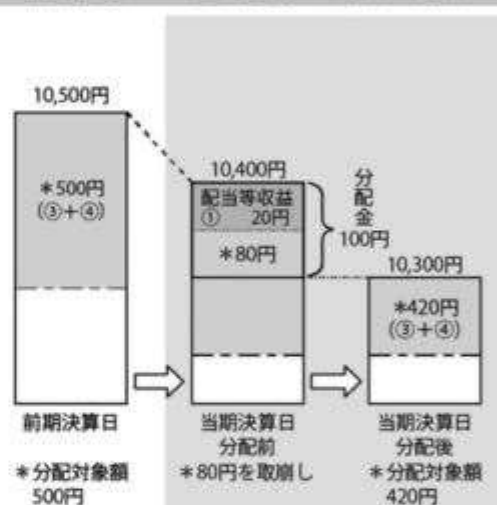
分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算日から基準価額が上昇した場合



前期決算日から基準価額が下落した場合



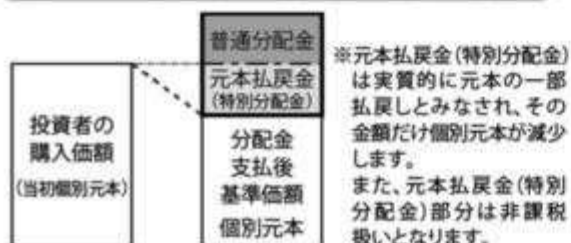
※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

分配準備積立金：当期の①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益のうち、当期分配金として支払わなかった残りの金額をいいます。信託財産に留保され、次期以降の分配金の支払いに充当できる分配対象額となります。

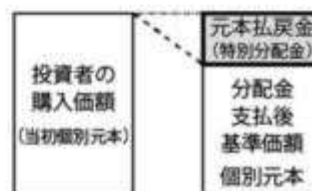
収益調整金：追加型投資信託で追加設定が行われることによって、既存の受益者への収益分配可能額が薄まらないようにするために設けられた勘定です。

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

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

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

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

■ファンドの仕組み

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



■主な投資制限

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（３）【ファンドの仕組み】

<訂正前>

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1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%

<訂正後>

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7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%

3【投資リスク】

<更新後>

（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。）

①価格変動リスク

一般に、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動するため、当ファンドはその影響を受

け公社債の価格が下落した場合には基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

②為替変動リスク

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

③信用リスク

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

④流動性リスク

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

※留意事項

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が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、換金の申込みの受け付け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。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・当ファンドは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに概ね連動することをめざして運用を行いますが、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、債券先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比の違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響、分配金を準備するためにファンド内に資金が滞留すること等の要因により乖離を生じることがあります。
- ・投資対象国における社会情勢の混乱や資産凍結を含む重大な規制の導入等による影響を受けることにより、価格変動・為替変動・信用・流動性のリスクが大きくなる可能性があります。

（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。

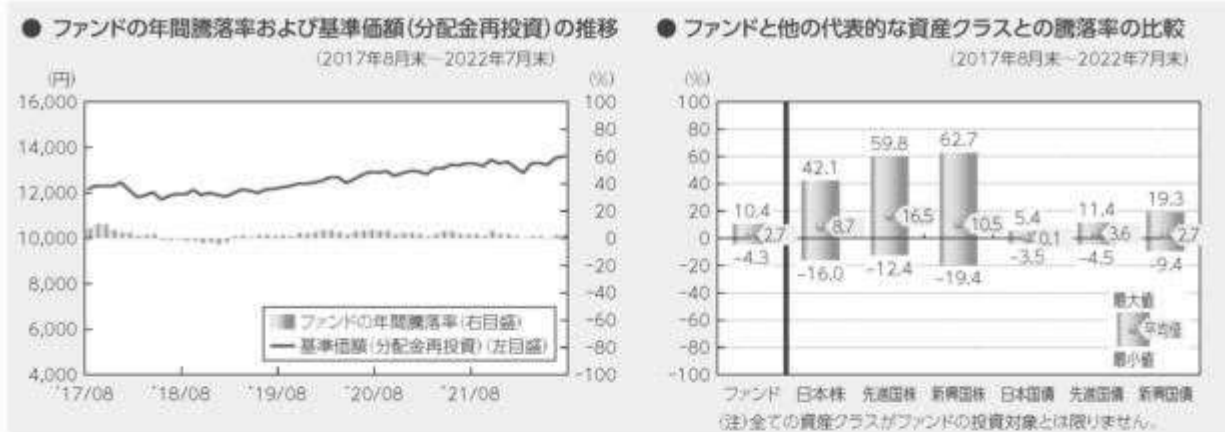
④内部監査担当部署

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】

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

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。

※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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

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

<訂正後>

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。

※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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

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

5【運用状況】

【三菱UFJ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）】

（1）【投資状況】

令和 4年 7月29日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	1,032,827,552	99.99
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	103,989	0.01
純資産総額		1,032,931,541	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 7月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	432,924,321	2.3939	1,036,377,533	2.3857	1,032,827,552	99.99

（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 7月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

（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7月末日、同日前１年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第64計算期間末日（平成24年 8月17日）	1,475,383,173	1,478,859,248	6,791	6,807
第65計算期間末日（平成24年 9月18日）	1,500,336,461	1,503,804,225	6,922	6,938
第66計算期間末日（平成24年10月17日）	1,507,714,171	1,511,175,853	6,969	6,985
第67計算期間末日（平成24年11月19日）	1,542,228,433	1,545,680,064	7,149	7,165
第68計算期間末日（平成24年12月17日）	1,593,493,971	1,596,899,373	7,487	7,503
第69計算期間末日（平成25年 1月17日）	1,606,927,230	1,610,179,577	7,905	7,921
第70計算期間末日（平成25年 2月18日）	1,624,618,064	1,627,759,249	8,275	8,291
第71計算期間末日（平成25年 3月18日）	1,576,599,063	1,579,655,075	8,254	8,270
第72計算期間末日（平成25年 4月17日）	1,578,585,274	1,581,483,173	8,716	8,732
第73計算期間末日（平成25年 5月17日）	1,579,376,051	1,582,189,239	8,983	8,999
第74計算期間末日（平成25年 6月17日）	1,396,778,502	1,399,461,074	8,331	8,347
第75計算期間末日（平成25年 7月17日）	1,416,913,140	1,419,562,212	8,558	8,574
第76計算期間末日（平成25年 8月19日）	1,371,026,035	1,373,638,406	8,397	8,413
第77計算期間末日（平成25年 9月17日）	1,385,830,705	1,388,436,048	8,511	8,527
第78計算期間末日（平成25年10月17日）	1,382,862,953	1,385,435,644	8,600	8,616
第79計算期間末日（平成25年11月18日）	1,387,540,268	1,390,075,343	8,757	8,773
第80計算期間末日（平成25年12月17日）	1,360,360,558	1,362,767,152	9,044	9,060
第81計算期間末日（平成26年 1月17日）	1,300,473,269	1,302,753,667	9,125	9,141
第82計算期間末日（平成26年 2月17日）	1,277,422,697	1,279,702,591	8,965	8,981

第83計算期間末日	（平成26年 3月17日）	1,296,479,256	1,298,766,843	9,068	9,084
第84計算期間末日	（平成26年 4月17日）	1,313,235,381	1,315,526,750	9,170	9,186
第85計算期間末日	（平成26年 5月19日）	1,308,107,921	1,310,399,636	9,133	9,149
第86計算期間末日	（平成26年 6月17日）	1,306,171,771	1,308,461,456	9,127	9,143
第87計算期間末日	（平成26年 7月17日）	1,299,507,924	1,301,784,071	9,135	9,151
第88計算期間末日	（平成26年 8月18日）	1,316,209,146	1,318,485,699	9,251	9,267
第89計算期間末日	（平成26年 9月17日）	1,341,013,272	1,343,287,257	9,436	9,452
第90計算期間末日	（平成26年10月17日）	1,338,915,441	1,341,191,243	9,413	9,429
第91計算期間末日	（平成26年11月17日）	1,407,946,724	1,410,163,822	10,161	10,177
第92計算期間末日	（平成26年12月17日）	1,390,683,801	1,392,845,626	10,293	10,309
第93計算期間末日	（平成27年 1月19日）	1,358,135,163	1,360,285,841	10,104	10,120
第94計算期間末日	（平成27年 2月17日）	1,337,307,109	1,339,435,731	10,052	10,068
第95計算期間末日	（平成27年 3月17日）	1,339,507,574	1,341,650,092	10,003	10,019
第96計算期間末日	（平成27年 4月17日）	1,329,129,260	1,331,260,455	9,978	9,994
第97計算期間末日	（平成27年 5月18日）	1,343,485,964	1,345,618,950	10,078	10,094
第98計算期間末日	（平成27年 6月17日）	1,330,412,332	1,332,514,484	10,126	10,142
第99計算期間末日	（平成27年 7月17日）	1,299,908,054	1,301,976,540	10,055	10,071
第100計算期間末日	（平成27年 8月17日）	1,326,495,189	1,328,568,512	10,237	10,253
第101計算期間末日	（平成27年 9月17日）	1,282,985,640	1,285,060,414	9,894	9,910
第102計算期間末日	（平成27年10月19日）	1,291,153,215	1,293,229,221	9,951	9,967
第103計算期間末日	（平成27年11月17日）	1,280,778,986	1,282,849,894	9,895	9,911
第104計算期間末日	（平成27年12月17日）	1,270,776,060	1,272,840,844	9,847	9,863
第105計算期間末日	（平成28年 1月18日）	1,226,001,062	1,228,076,843	9,450	9,466
第106計算期間末日	（平成28年 2月17日）	1,212,731,907	1,214,791,536	9,421	9,437
第107計算期間末日	（平成28年 3月17日）	1,201,437,733	1,203,498,399	9,329	9,345
第108計算期間末日	（平成28年 4月18日）	1,178,717,073	1,180,803,025	9,041	9,057
第109計算期間末日	（平成28年 5月17日）	1,194,333,428	1,196,434,677	9,094	9,110
第110計算期間末日	（平成28年 6月17日）	1,163,352,288	1,165,465,096	8,810	8,826
第111計算期間末日	（平成28年 7月19日）	1,173,731,214	1,175,848,760	8,869	8,885
第112計算期間末日	（平成28年 8月17日）	1,129,895,028	1,132,016,003	8,524	8,540
第113計算期間末日	（平成28年 9月20日）	1,126,061,540	1,128,185,634	8,482	8,498
第114計算期間末日	（平成28年10月17日）	1,129,159,475	1,131,283,621	8,505	8,521
第115計算期間末日	（平成28年11月17日）	1,138,180,599	1,140,310,701	8,549	8,565
第116計算期間末日	（平成28年12月19日）	1,198,513,277	1,200,629,004	9,064	9,080
第117計算期間末日	（平成29年 1月17日）	1,163,395,576	1,165,494,024	8,871	8,887
第118計算期間末日	（平成29年 2月17日）	1,145,864,739	1,147,944,735	8,814	8,830
第119計算期間末日	（平成29年 3月17日）	1,144,288,556	1,146,370,450	8,794	8,810
第120計算期間末日	（平成29年 4月17日）	1,099,655,400	1,101,733,889	8,465	8,481
第121計算期間末日	（平成29年 5月17日）	1,158,401,282	1,160,477,722	8,926	8,942
第122計算期間末日	（平成29年 6月19日）	1,151,365,597	1,153,430,201	8,923	8,939
第123計算期間末日	（平成29年 7月18日）	1,165,264,820	1,167,324,523	9,052	9,068
第124計算期間末日	（平成29年 8月17日）	1,160,970,707	1,163,034,858	8,999	9,015
第125計算期間末日	（平成29年 9月19日）	1,182,112,068	1,184,171,545	9,184	9,200

第126計算期間末日	（平成29年10月17日）	1,160,475,383	1,162,504,073	9,153	9,169
第127計算期間末日	（平成29年11月17日）	1,153,562,619	1,155,571,663	9,187	9,203
第128計算期間末日	（平成29年12月18日）	1,152,277,964	1,154,281,801	9,201	9,217
第129計算期間末日	（平成30年 1月17日）	1,144,435,554	1,146,442,166	9,125	9,141
第130計算期間末日	（平成30年 2月19日）	1,094,230,159	1,096,234,978	8,733	8,749
第131計算期間末日	（平成30年 3月19日）	1,096,477,071	1,098,498,971	8,677	8,693
第132計算期間末日	（平成30年 4月17日）	1,120,499,621	1,122,526,736	8,844	8,860
第133計算期間末日	（平成30年 5月17日）	1,109,797,889	1,111,825,074	8,759	8,775
第134計算期間末日	（平成30年 6月18日）	1,093,174,938	1,095,182,436	8,713	8,729
第135計算期間末日	（平成30年 7月17日）	1,122,553,012	1,124,563,985	8,931	8,947
第136計算期間末日	（平成30年 8月17日）	1,083,095,933	1,085,105,243	8,625	8,641
第137計算期間末日	（平成30年 9月18日）	1,101,064,984	1,103,077,259	8,755	8,771
第138計算期間末日	（平成30年10月17日）	1,083,189,089	1,085,186,253	8,678	8,694
第139計算期間末日	（平成30年11月19日）	1,075,875,482	1,077,865,567	8,650	8,666
第140計算期間末日	（平成30年12月17日）	1,090,589,198	1,092,582,331	8,755	8,771
第141計算期間末日	（平成31年 1月17日）	1,059,147,369	1,061,140,877	8,501	8,517
第142計算期間末日	（平成31年 2月18日）	1,078,506,729	1,080,506,765	8,628	8,644
第143計算期間末日	（平成31年 3月18日）	1,090,825,878	1,092,819,481	8,755	8,771
第144計算期間末日	（平成31年 4月17日）	1,090,236,984	1,092,221,983	8,788	8,804
第145計算期間末日	（令和 1年 5月17日）	1,075,079,980	1,077,072,242	8,634	8,650
第146計算期間末日	（令和 1年 6月17日）	1,081,793,703	1,083,786,730	8,685	8,701
第147計算期間末日	（令和 1年 7月17日）	1,085,516,226	1,087,515,687	8,686	8,702
第148計算期間末日	（令和 1年 8月19日）	1,091,070,196	1,093,066,099	8,746	8,762
第149計算期間末日	（令和 1年 9月17日）	1,088,280,206	1,090,270,435	8,749	8,765
第150計算期間末日	（令和 1年10月17日）	1,099,048,693	1,101,039,754	8,832	8,848
第151計算期間末日	（令和 1年11月18日）	1,084,704,508	1,086,685,678	8,760	8,776
第152計算期間末日	（令和 1年12月17日）	1,094,879,034	1,096,861,619	8,836	8,852
第153計算期間末日	（令和 2年 1月17日）	1,097,887,270	1,099,863,140	8,890	8,906
第154計算期間末日	（令和 2年 2月17日）	1,087,716,902	1,089,679,730	8,867	8,883
第155計算期間末日	（令和 2年 3月17日）	1,055,547,447	1,057,477,109	8,752	8,768
第156計算期間末日	（令和 2年 4月17日）	1,021,094,748	1,022,940,422	8,852	8,868
第157計算期間末日	（令和 2年 5月18日）	1,012,084,379	1,013,937,223	8,740	8,756
第158計算期間末日	（令和 2年 6月17日）	1,035,209,926	1,037,064,945	8,929	8,945
第159計算期間末日	（令和 2年 7月17日）	1,049,795,335	1,051,654,584	9,034	9,050
第160計算期間末日	（令和 2年 8月17日）	1,055,424,316	1,057,275,996	9,120	9,136
第161計算期間末日	（令和 2年 9月17日）	1,036,682,853	1,038,529,211	8,984	9,000
第162計算期間末日	（令和 2年10月19日）	1,044,166,853	1,046,020,149	9,015	9,031
第163計算期間末日	（令和 2年11月17日）	1,032,907,094	1,034,757,137	8,933	8,949
第164計算期間末日	（令和 2年12月17日）	1,036,491,390	1,038,337,990	8,981	8,997
第165計算期間末日	（令和 3年 1月18日）	1,022,120,271	1,023,955,129	8,913	8,929
第166計算期間末日	（令和 3年 2月17日）	1,020,462,806	1,022,281,411	8,978	8,994
第167計算期間末日	（令和 3年 3月17日）	1,021,735,101	1,023,544,676	9,034	9,050

第168計算期間末日	(令和 3年 4月19日)	1,012,633,528	1,014,435,684	8,990	9,006
第169計算期間末日	(令和 3年 5月17日)	1,030,182,534	1,032,009,277	9,023	9,039
第170計算期間末日	(令和 3年 6月17日)	1,042,855,936	1,044,680,971	9,143	9,159
第171計算期間末日	(令和 3年 7月19日)	1,037,681,557	1,039,510,101	9,080	9,096
第172計算期間末日	(令和 3年 8月17日)	1,035,772,621	1,037,601,410	9,062	9,078
第173計算期間末日	(令和 3年 9月17日)	1,030,017,040	1,031,843,583	9,023	9,039
第174計算期間末日	(令和 3年10月18日)	1,042,306,918	1,044,121,701	9,189	9,205
第175計算期間末日	(令和 3年11月17日)	1,022,005,885	1,023,798,483	9,122	9,138
第176計算期間末日	(令和 3年12月17日)	1,019,953,834	1,021,747,830	9,097	9,113
第177計算期間末日	(令和 4年 1月17日)	1,002,036,926	1,003,825,053	8,966	8,982
第178計算期間末日	(令和 4年 2月17日)	982,092,903	983,883,023	8,778	8,794
第179計算期間末日	(令和 4年 3月17日)	987,389,904	989,182,470	8,813	8,829
第180計算期間末日	(令和 4年 4月18日)	1,007,281,611	1,009,077,752	8,973	8,989
第181計算期間末日	(令和 4年 5月17日)	999,105,599	1,000,901,615	8,901	8,917
第182計算期間末日	(令和 4年 6月17日)	990,369,908	992,169,222	8,807	8,823
第183計算期間末日	(令和 4年 7月19日)	1,035,928,957	1,037,732,803	9,189	9,205
	令和 3年 7月末日	1,045,943,185	—	9,131	—
	8月末日	1,040,996,800	—	9,106	—
	9月末日	1,029,743,912	—	9,021	—
	10月末日	1,041,506,211	—	9,191	—
	11月末日	1,015,829,007	—	9,066	—
	12月末日	1,022,040,487	—	9,100	—
	令和 4年 1月末日	998,737,407	—	8,920	—
	2月末日	978,226,659	—	8,738	—
	3月末日	1,010,342,956	—	9,003	—
	4月末日	1,010,442,287	—	9,001	—
	5月末日	1,004,045,071	—	8,926	—
	6月末日	1,026,915,699	—	9,114	—
	7月末日	1,032,931,541	—	9,155	—

②【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第64計算期間	16円
第65計算期間	16円
第66計算期間	16円
第67計算期間	16円
第68計算期間	16円
第69計算期間	16円
第70計算期間	16円
第71計算期間	16円
第72計算期間	16円

第73計算期間	16円
第74計算期間	16円
第75計算期間	16円
第76計算期間	16円
第77計算期間	16円
第78計算期間	16円
第79計算期間	16円
第80計算期間	16円
第81計算期間	16円
第82計算期間	16円
第83計算期間	16円
第84計算期間	16円
第85計算期間	16円
第86計算期間	16円
第87計算期間	16円
第88計算期間	16円
第89計算期間	16円
第90計算期間	16円
第91計算期間	16円
第92計算期間	16円
第93計算期間	16円
第94計算期間	16円
第95計算期間	16円
第96計算期間	16円
第97計算期間	16円
第98計算期間	16円
第99計算期間	16円
第100計算期間	16円
第101計算期間	16円
第102計算期間	16円
第103計算期間	16円
第104計算期間	16円
第105計算期間	16円
第106計算期間	16円
第107計算期間	16円
第108計算期間	16円
第109計算期間	16円
第110計算期間	16円
第111計算期間	16円
第112計算期間	16円
第113計算期間	16円
第114計算期間	16円
第115計算期間	16円

第116計算期間	16円
第117計算期間	16円
第118計算期間	16円
第119計算期間	16円
第120計算期間	16円
第121計算期間	16円
第122計算期間	16円
第123計算期間	16円
第124計算期間	16円
第125計算期間	16円
第126計算期間	16円
第127計算期間	16円
第128計算期間	16円
第129計算期間	16円
第130計算期間	16円
第131計算期間	16円
第132計算期間	16円
第133計算期間	16円
第134計算期間	16円
第135計算期間	16円
第136計算期間	16円
第137計算期間	16円
第138計算期間	16円
第139計算期間	16円
第140計算期間	16円
第141計算期間	16円
第142計算期間	16円
第143計算期間	16円
第144計算期間	16円
第145計算期間	16円
第146計算期間	16円
第147計算期間	16円
第148計算期間	16円
第149計算期間	16円
第150計算期間	16円
第151計算期間	16円
第152計算期間	16円
第153計算期間	16円
第154計算期間	16円
第155計算期間	16円
第156計算期間	16円
第157計算期間	16円
第158計算期間	16円

第159計算期間	16円
第160計算期間	16円
第161計算期間	16円
第162計算期間	16円
第163計算期間	16円
第164計算期間	16円
第165計算期間	16円
第166計算期間	16円
第167計算期間	16円
第168計算期間	16円
第169計算期間	16円
第170計算期間	16円
第171計算期間	16円
第172計算期間	16円
第173計算期間	16円
第174計算期間	16円
第175計算期間	16円
第176計算期間	16円
第177計算期間	16円
第178計算期間	16円
第179計算期間	16円
第180計算期間	16円
第181計算期間	16円
第182計算期間	16円
第183計算期間	16円

③【収益率の推移】

	収益率（％）
第64計算期間	0.26
第65計算期間	2.16
第66計算期間	0.91
第67計算期間	2.81
第68計算期間	4.95
第69計算期間	5.79
第70計算期間	4.88
第71計算期間	△0.06
第72計算期間	5.79
第73計算期間	3.24
第74計算期間	△7.08
第75計算期間	2.91
第76計算期間	△1.69

第77計算期間	1.54
第78計算期間	1.23
第79計算期間	2.01
第80計算期間	3.46
第81計算期間	1.07
第82計算期間	△1.57
第83計算期間	1.32
第84計算期間	1.30
第85計算期間	△0.22
第86計算期間	0.10
第87計算期間	0.26
第88計算期間	1.44
第89計算期間	2.17
第90計算期間	△0.07
第91計算期間	8.11
第92計算期間	1.45
第93計算期間	△1.68
第94計算期間	△0.35
第95計算期間	△0.32
第96計算期間	△0.08
第97計算期間	1.16
第98計算期間	0.63
第99計算期間	△0.54
第100計算期間	1.96
第101計算期間	△3.19
第102計算期間	0.73
第103計算期間	△0.40
第104計算期間	△0.32
第105計算期間	△3.86
第106計算期間	△0.13
第107計算期間	△0.80
第108計算期間	△2.91
第109計算期間	0.76
第110計算期間	△2.94
第111計算期間	0.85
第112計算期間	△3.70
第113計算期間	△0.30
第114計算期間	0.45
第115計算期間	0.70
第116計算期間	6.21
第117計算期間	△1.95
第118計算期間	△0.46
第119計算期間	△0.04

第120計算期間	△3.55
第121計算期間	5.63
第122計算期間	0.14
第123計算期間	1.62
第124計算期間	△0.40
第125計算期間	2.23
第126計算期間	△0.16
第127計算期間	0.54
第128計算期間	0.32
第129計算期間	△0.65
第130計算期間	△4.12
第131計算期間	△0.45
第132計算期間	2.10
第133計算期間	△0.78
第134計算期間	△0.34
第135計算期間	2.68
第136計算期間	△3.24
第137計算期間	1.69
第138計算期間	△0.69
第139計算期間	△0.13
第140計算期間	1.39
第141計算期間	△2.71
第142計算期間	1.68
第143計算期間	1.65
第144計算期間	0.55
第145計算期間	△1.57
第146計算期間	0.77
第147計算期間	0.19
第148計算期間	0.87
第149計算期間	0.21
第150計算期間	1.13
第151計算期間	△0.63
第152計算期間	1.05
第153計算期間	0.79
第154計算期間	△0.07
第155計算期間	△1.11
第156計算期間	1.32
第157計算期間	△1.08
第158計算期間	2.34
第159計算期間	1.35
第160計算期間	1.12
第161計算期間	△1.31
第162計算期間	0.52

第163計算期間	△0.73
第164計算期間	0.71
第165計算期間	△0.57
第166計算期間	0.90
第167計算期間	0.80
第168計算期間	△0.30
第169計算期間	0.54
第170計算期間	1.50
第171計算期間	△0.51
第172計算期間	△0.02
第173計算期間	△0.25
第174計算期間	2.01
第175計算期間	△0.55
第176計算期間	△0.09
第177計算期間	△1.26
第178計算期間	△1.91
第179計算期間	0.58
第180計算期間	1.99
第181計算期間	△0.62
第182計算期間	△0.87
第183計算期間	4.51

（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64計算期間	22,230,119	17,718,470	2,172,547,292
第65計算期間	15,752,437	20,946,760	2,167,352,969
第66計算期間	14,626,256	18,427,926	2,163,551,299
第67計算期間	14,719,788	21,001,464	2,157,269,623
第68計算期間	20,798,987	49,691,771	2,128,376,839
第69計算期間	29,671,683	125,331,467	2,032,717,055
第70計算期間	17,404,428	86,880,792	1,963,240,691
第71計算期間	14,320,310	67,552,942	1,910,008,059
第72計算期間	17,905,200	116,726,045	1,811,187,214
第73計算期間	14,263,276	67,207,904	1,758,242,586
第74計算期間	14,477,880	96,112,903	1,676,607,563
第75計算期間	10,530,802	31,468,263	1,655,670,102
第76計算期間	11,906,354	34,844,268	1,632,732,188
第77計算期間	12,389,645	16,782,268	1,628,339,565
第78計算期間	11,168,006	31,575,361	1,607,932,210
第79計算期間	13,287,127	36,797,134	1,584,422,203

第80計算期間	13,525,838	93,826,657	1,504,121,384
第81計算期間	39,747,627	118,619,801	1,425,249,210
第82計算期間	12,634,094	12,949,365	1,424,933,939
第83計算期間	14,094,702	9,286,616	1,429,742,025
第84計算期間	18,840,956	16,476,760	1,432,106,221
第85計算期間	14,491,419	14,275,533	1,432,322,107
第86計算期間	11,558,246	12,826,656	1,431,053,697
第87計算期間	37,798,775	46,260,100	1,422,592,372
第88計算期間	12,444,557	12,190,866	1,422,846,063
第89計算期間	17,779,380	19,384,589	1,421,240,854
第90計算期間	30,073,620	28,937,871	1,422,376,603
第91計算期間	18,239,363	54,929,408	1,385,686,558
第92計算期間	13,813,892	48,359,363	1,351,141,087
第93計算期間	15,173,134	22,140,064	1,344,174,157
第94計算期間	10,982,417	24,767,806	1,330,388,768
第95計算期間	21,558,350	12,873,251	1,339,073,867
第96計算期間	13,331,748	20,408,457	1,331,997,158
第97計算期間	11,718,614	10,599,240	1,333,116,532
第98計算期間	8,756,377	28,027,619	1,313,845,290
第99計算期間	9,373,453	30,414,966	1,292,803,777
第100計算期間	9,184,969	6,161,478	1,295,827,268
第101計算期間	10,912,769	10,006,007	1,296,734,030
第102計算期間	8,548,972	7,779,080	1,297,503,922
第103計算期間	8,108,941	11,294,867	1,294,317,996
第104計算期間	7,788,982	11,616,625	1,290,490,353
第105計算期間	10,847,005	3,974,206	1,297,363,152
第106計算期間	9,479,922	19,574,913	1,287,268,161
第107計算期間	15,263,201	14,614,710	1,287,916,652
第108計算期間	22,120,158	6,316,600	1,303,720,210
第109計算期間	13,396,768	3,836,047	1,313,280,931
第110計算期間	14,211,321	6,986,842	1,320,505,410
第111計算期間	11,070,867	8,109,536	1,323,466,741
第112計算期間	8,505,084	6,361,872	1,325,609,953
第113計算期間	8,367,339	6,418,370	1,327,558,922
第114計算期間	7,953,618	7,921,049	1,327,591,491
第115計算期間	8,733,310	5,010,441	1,331,314,360
第116計算期間	7,234,875	16,219,346	1,322,329,889
第117計算期間	7,372,664	18,172,453	1,311,530,100
第118計算期間	9,577,587	21,109,650	1,299,998,037
第119計算期間	8,193,945	7,007,927	1,301,184,055
第120計算期間	7,525,569	9,653,628	1,299,055,996
第121計算期間	7,608,915	8,889,294	1,297,775,617
第122計算期間	7,122,026	14,520,078	1,290,377,565

第123計算期間	7,455,512	10,518,307	1,287,314,770
第124計算期間	10,726,404	7,946,645	1,290,094,529
第125計算期間	8,628,402	11,549,265	1,287,173,666
第126計算期間	8,158,726	27,400,712	1,267,931,680
第127計算期間	7,540,002	19,818,575	1,255,653,107
第128計算期間	7,248,128	10,502,722	1,252,398,513
第129計算期間	8,269,080	6,534,976	1,254,132,617
第130計算期間	8,524,551	9,644,891	1,253,012,277
第131計算期間	19,182,341	8,506,501	1,263,688,117
第132計算期間	7,428,472	4,169,341	1,266,947,248
第133計算期間	9,823,237	9,779,277	1,266,991,208
第134計算期間	9,064,956	21,369,731	1,254,686,433
第135計算期間	7,282,582	5,110,507	1,256,858,508
第136計算期間	8,567,784	9,607,255	1,255,819,037
第137計算期間	6,874,612	5,021,525	1,257,672,124
第138計算期間	7,204,937	16,649,302	1,248,227,759
第139計算期間	6,997,281	11,421,711	1,243,803,329
第140計算期間	6,674,673	4,769,826	1,245,708,176
第141計算期間	8,580,699	8,346,142	1,245,942,733
第142計算期間	5,737,972	1,658,122	1,250,022,583
第143計算期間	5,842,387	9,862,638	1,246,002,332
第144計算期間	5,592,836	10,970,721	1,240,624,447
第145計算期間	6,081,750	1,542,257	1,245,163,940
第146計算期間	5,597,085	5,118,619	1,245,642,406
第147計算期間	9,936,768	5,915,863	1,249,663,311
第148計算期間	6,627,176	8,851,005	1,247,439,482
第149計算期間	5,384,398	8,930,636	1,243,893,244
第150計算期間	10,252,766	9,732,681	1,244,413,329
第151計算期間	10,195,905	16,377,939	1,238,231,295
第152計算期間	6,636,173	5,751,426	1,239,116,042
第153計算期間	6,475,063	10,672,110	1,234,918,995
第154計算期間	5,267,961	13,418,989	1,226,767,967
第155計算期間	6,425,298	27,154,194	1,206,039,071
第156計算期間	8,726,336	61,218,609	1,153,546,798
第157計算期間	6,269,357	1,788,202	1,158,027,953
第158計算期間	6,301,465	4,941,994	1,159,387,424
第159計算期間	5,856,451	3,213,136	1,162,030,739
第160計算期間	5,210,412	9,940,848	1,157,300,303
第161計算期間	5,780,351	9,106,513	1,153,974,141
第162計算期間	10,838,509	6,502,124	1,158,310,526
第163計算期間	13,240,940	15,274,212	1,156,277,254
第164計算期間	6,313,553	8,465,372	1,154,125,435
第165計算期間	6,447,516	13,786,128	1,146,786,823

第166計算期間	7,791,111	17,949,658	1,136,628,276
第167計算期間	7,030,605	12,674,369	1,130,984,512
第168計算期間	6,872,066	11,508,861	1,126,347,717
第169計算期間	22,450,207	7,083,335	1,141,714,589
第170計算期間	6,495,984	7,563,334	1,140,647,239
第171計算期間	7,388,193	5,195,047	1,142,840,385
第172計算期間	5,972,634	5,819,835	1,142,993,184
第173計算期間	6,259,416	7,662,659	1,141,589,941
第174計算期間	5,488,668	12,838,975	1,134,239,634
第175計算期間	5,287,328	19,152,588	1,120,374,374
第176計算期間	6,682,081	5,808,520	1,121,247,935
第177計算期間	5,100,051	8,768,285	1,117,579,701
第178計算期間	5,716,338	4,470,876	1,118,825,163
第179計算期間	4,920,253	3,391,148	1,120,354,268
第180計算期間	4,714,120	2,479,876	1,122,588,512
第181計算期間	4,897,296	4,975,532	1,122,510,276
第182計算期間	5,514,173	3,452,588	1,124,571,861
第183計算期間	4,659,434	1,827,404	1,127,403,891

（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 7月29日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	162,680,430,988	50.40
	フランス	28,295,010,242	8.77
	イタリア	25,012,928,152	7.75
	ドイツ	21,155,644,580	6.55
	スペイン	16,856,979,586	5.22
	イギリス	16,190,355,182	5.02
	中国	7,045,543,875	2.18
	カナダ	6,536,557,680	2.03
	ベルギー	6,449,839,586	2.00
	オランダ	5,475,078,061	1.70
	オーストラリア	4,931,971,426	1.53
	オーストリア	4,354,999,424	1.35
	メキシコ	2,443,731,184	0.76
	アイルランド	2,125,056,745	0.66
	フィンランド	1,853,565,277	0.57

	マレーシア	1,617,028,630	0.50
	シンガポール	1,345,643,517	0.42
	ポーランド	1,283,652,461	0.40
	イスラエル	1,260,829,092	0.39
	デンマーク	1,181,163,564	0.37
	スウェーデン	829,190,318	0.26
	ノルウェー	641,705,044	0.20
小計		319,566,904,614	99.01
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	3,211,416,638	0.99
純資産総額		322,778,321,252	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 7月29日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	0.75 T-NOTE 260331	15,950,000	12,415.14	1,980,215,370	12,511.36	1,995,563,278	0.750000	2026/3/31	0.62
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 231115	13,040,000	13,523.04	1,763,405,303	13,434.70	1,751,886,052	2.750000	2023/11/15	0.54
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280515	12,490,000	13,416.83	1,675,762,203	13,546.18	1,691,918,243	2.875000	2028/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 310815	14,130,000	11,656.20	1,647,021,587	11,946.63	1,688,059,879	1.250000	2031/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 311115	13,900,000	11,722.06	1,629,366,673	12,029.71	1,672,130,677	1.375000	2031/11/15	0.52
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280815	11,510,000	13,402.10	1,542,582,646	13,552.49	1,559,891,914	2.875000	2028/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 240531	11,730,000	13,286.42	1,558,497,963	13,249.09	1,554,118,773	2.000000	2024/5/31	0.48
アメリカ	国債証券	1.875 T-NOTE 320215	12,300,000	12,265.19	1,508,619,488	12,553.43	1,544,072,395	1.875000	2032/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	0.875 T-NOTE 301115	12,980,000	11,412.92	1,481,398,297	11,702.65	1,519,004,862	0.875000	2030/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 310515	11,950,000	12,098.74	1,445,800,242	12,379.91	1,479,399,655	1.625000	2031/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 310215	12,380,000	11,624.05	1,439,058,253	11,910.88	1,474,567,157	1.125000	2031/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300815	12,260,000	11,211.54	1,374,534,890	11,487.07	1,408,314,848	0.625000	2030/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	2.125 T-NOTE 240331	10,160,000	13,346.37	1,355,991,311	13,286.42	1,349,901,050	2.125000	2024/3/31	0.42
アメリカ	国債証券	0.375 T-NOTE 240915	10,000,000	12,743.78	1,274,378,109	12,769.02	1,276,902,047	0.375000	2024/9/15	0.40
アメリカ	国債証券	0.375 T-NOTE 251130	10,150,000	12,338.37	1,252,344,921	12,414.61	1,260,083,684	0.375000	2025/11/30	0.39
アメリカ	国債証券	0.875 T-NOTE 260930	10,000,000	12,348.89	1,234,889,003	12,468.77	1,246,877,706	0.875000	2026/9/30	0.39

アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 280331	9,950,000	12,233.73	1,217,256,670	12,404.10	1,234,208,066	1.250000	2028/3/31	0.38
アメリカ	国債証券	2.5 T-NOTE 240515	9,100,000	13,426.29	1,221,792,923	13,368.45	1,216,529,462	2.500000	2024/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	0.125 T-NOTE 231015	9,200,000	13,034.03	1,199,131,119	13,021.41	1,197,970,108	0.125000	2023/10/15	0.37
アメリカ	国債証券	0.125 T-NOTE 240115	9,100,000	12,937.28	1,177,292,749	12,923.61	1,176,048,658	0.125000	2024/1/15	0.36
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 240131	8,750,000	13,390.54	1,171,672,256	13,326.39	1,166,059,125	2.250000	2024/1/31	0.36
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 271231	9,630,000	11,865.66	1,142,663,171	12,030.76	1,158,563,031	0.625000	2027/12/31	0.36
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 280215	8,490,000	13,334.46	1,132,096,214	13,456.79	1,142,481,762	2.750000	2028/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	3 T-NOTE 251031	8,300,000	13,533.56	1,123,285,745	13,531.45	1,123,111,173	3.000000	2025/10/31	0.35
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 240215	8,260,000	13,498.85	1,115,005,759	13,426.29	1,109,012,037	2.750000	2024/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 250831	8,250,000	13,417.88	1,106,975,324	13,412.62	1,106,541,523	2.750000	2025/8/31	0.34
アメリカ	国債証券	0.125 T-NOTE 231215	8,500,000	12,966.72	1,102,171,956	12,953.58	1,101,054,587	0.125000	2023/12/15	0.34
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 320515	8,030,000	13,447.59	1,079,842,220	13,684.99	1,098,905,455	2.875000	2032/5/15	0.34
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 250215	8,110,000	13,180.21	1,068,915,189	13,182.31	1,069,085,765	2.000000	2025/2/15	0.33
アメリカ	国債証券	3.125 T-NOTE 281115	7,740,000	13,594.26	1,052,196,026	13,757.56	1,064,835,349	3.125000	2028/11/15	0.33

（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 7月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	99.01
合計	99.01

（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。

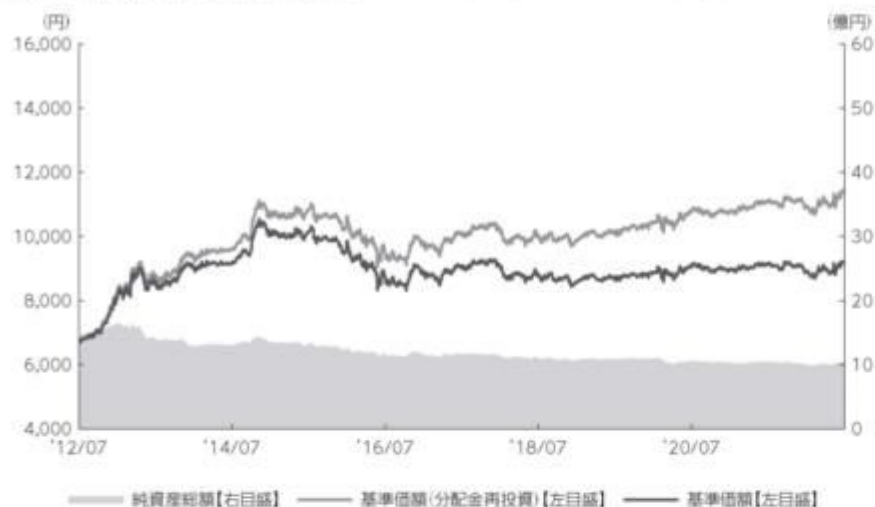
《参考情報》



運用実績

2022年7月29日現在

■基準価額・純資産の推移 2012年7月31日～2022年7月29日



- 基準価額(分配金再投資)はグラフの起点における基準価額に合わせて指数化
- 基準価額、基準価額(分配金再投資)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	9,155円
純資産総額	10.3億円

•純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2022年 7月	16円
2022年 6月	16円
2022年 5月	16円
2022年 4月	16円
2022年 3月	16円
2022年 2月	16円
直近1年間累計	192円
設定来累計	3,411円

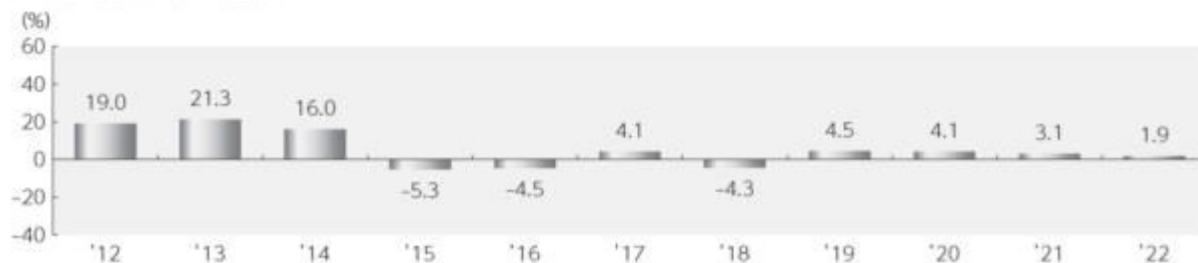
•分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	種別	国・地域	比率
1 アメリカドル	50.8%	1 0.75 T-NOTE 260331	国債	アメリカ	0.6%
2 ユーロ	34.9%	2 2.75 T-NOTE 231115	国債	アメリカ	0.5%
3 イギリスポンド	5.1%	3 2.875 T-NOTE 280515	国債	アメリカ	0.5%
4 中国元	2.3%	4 1.25 T-NOTE 310815	国債	アメリカ	0.5%
5 カナダドル	2.1%	5 1.375 T-NOTE 311115	国債	アメリカ	0.5%
6 オーストラリアドル	1.6%	6 2.875 T-NOTE 280815	国債	アメリカ	0.5%
7 メキシコペソ	0.8%	7 2 T-NOTE 240531	国債	アメリカ	0.5%
8 マレーシアリンギット	0.5%	8 1.875 T-NOTE 320215	国債	アメリカ	0.5%
9 シンガポールドル	0.4%	9 0.875 T-NOTE 301115	国債	アメリカ	0.5%
10 ポーランドズロチ	0.4%	10 1.625 T-NOTE 310515	国債	アメリカ	0.5%

- 各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- 「国・地域」は原則、発行通貨ベースで分類しています。(ただし、発行通貨がユーロの場合は発行地)

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- 2022年は年初から7月29日までの収益率を表示

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 毎月決算ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。

- 3 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（令和4年1月18日から令和4年7月19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】

【三菱UFJ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）】

（1）【貸借対照表】

(単位：円)		
	前期 [令和 4年 1月17日現在]	当期 [令和 4年 7月19日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,322,777	984,044
親投資信託受益証券	1,001,684,342	1,035,541,807
未収入金	2,543,043	2,004,068
流動資産合計	1,005,550,162	1,038,529,919
資産合計	1,005,550,162	1,038,529,919
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,788,127	1,803,846
未払解約金	1,007,968	53,973
未払受託者報酬	47,544	49,266
未払委託者報酬	665,613	689,749
未払利息	1	-
その他未払費用	3,983	4,128
流動負債合計	3,513,236	2,600,962
負債合計	3,513,236	2,600,962
純資産の部		
元本等		
元本	1,117,579,701	1,127,403,891
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△115,542,775	△91,474,934
（分配準備積立金）	83,962,001	79,363,259
元本等合計	1,002,036,926	1,035,928,957
純資産合計	1,002,036,926	1,035,928,957
負債純資産合計	1,005,550,162	1,038,529,919

（2）【損益及び剰余金計算書】

	前期 自 令和 3年 7月20日 至 令和 4年 1月17日	当期 自 令和 4年 1月18日 至 令和 4年 7月19日
営業収益		
有価証券売買等損益	2,570,191	40,109,122
営業収益合計	2,570,191	40,109,122
営業費用		
支払利息	27	8
受託者報酬	282,620	276,351
委託者報酬	3,956,633	3,868,886
その他費用	23,681	23,153
営業費用合計	4,262,961	4,168,398
営業利益又は営業損失（△）	△1,692,770	35,940,724
経常利益又は経常損失（△）	△1,692,770	35,940,724
当期純利益又は当期純損失（△）	△1,692,770	35,940,724
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（△）	64,937	52,937
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△105,158,828	△115,542,775
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,363,549	2,279,625
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,363,549	2,279,625
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,144,953	3,321,568
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,144,953	3,321,568
分配金	10,844,836	10,778,003
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△115,542,775	△91,474,934

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は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	ファンドの特定期間 当ファンドは、原則として毎年1月17日および7月17日を特定期間の末日としておりますが、当特定期間においては当該日が休業日のため、当特定期間は令和 4年 1月18日から令和 4年 7月19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特定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）

	前期 [令和 4年 1月17日現在]	当期 [令和 4年 7月19日現在]
1. 期首元本額	1,142,840,385円	1,117,579,701円
期中追加設定元本額	34,790,178円	30,421,614円
期中一部解約元本額	60,050,862円	20,597,424円
2. 元本の欠損		

	前期 [令和 4年 1月17日現在]	当期 [令和 4年 7月19日現在]
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	115,542,775円	91,474,934円
3. 受益権の総数	1,117,579,701口	1,127,403,891口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 令和 3年 7月20日 至 令和 4年 1月17日	当期 自 令和 4年 1月18日 至 令和 4年 7月19日																																																												
1. 分配金の計算過程 第172期 令和 3年 7月20日 令和 3年 8月17日	1. 分配金の計算過程 第178期 令和 4年 1月18日 令和 4年 2月17日																																																												
<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>1,048,653円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>－円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>104,581,638円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>92,611,263円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>198,241,554円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>1,142,993,184口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>1,734円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>16円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>1,828,789円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,048,653円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	収益調整金額	C	104,581,638円	分配準備積立金額	D	92,611,263円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	198,241,554円	当ファンドの期末残存口数	F	1,142,993,184口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,734円	1万口当たり分配金額	H	16円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,828,789円	<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>910,330円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>－円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>105,047,562円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>83,627,272円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>189,585,164円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>1,118,825,163口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>1,694円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>16円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>1,790,120円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	910,330円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	収益調整金額	C	105,047,562円	分配準備積立金額	D	83,627,272円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	189,585,164円	当ファンドの期末残存口数	F	1,118,825,163口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,694円	1万口当たり分配金額	H	16円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,790,120円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,048,653円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円																																																											
収益調整金額	C	104,581,638円																																																											
分配準備積立金額	D	92,611,263円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	198,241,554円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,142,993,184口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,734円																																																											
1万口当たり分配金額	H	16円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,828,789円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	910,330円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円																																																											
収益調整金額	C	105,047,562円																																																											
分配準備積立金額	D	83,627,272円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	189,585,164円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,118,825,163口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,694円																																																											
1万口当たり分配金額	H	16円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,790,120円																																																											
第173期 令和 3年 8月18日 令和 3年 9月17日	第179期 令和 4年 2月18日 令和 4年 3月17日																																																												
<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>1,068,117円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>－円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>104,957,563円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>91,217,248円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>197,242,928円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>1,141,589,941口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>1,727円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>16円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>1,826,543円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,068,117円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	収益調整金額	C	104,957,563円	分配準備積立金額	D	91,217,248円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	197,242,928円	当ファンドの期末残存口数	F	1,141,589,941口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,727円	1万口当たり分配金額	H	16円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,826,543円	<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>1,301,166円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>－円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>105,555,520円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>82,497,428円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>189,354,114円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>1,120,354,268口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>1,690円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>16円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>1,792,566円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,301,166円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	収益調整金額	C	105,555,520円	分配準備積立金額	D	82,497,428円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	189,354,114円	当ファンドの期末残存口数	F	1,120,354,268口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,690円	1万口当たり分配金額	H	16円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,792,566円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,068,117円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円																																																											
収益調整金額	C	104,957,563円																																																											
分配準備積立金額	D	91,217,248円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	197,242,928円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,141,589,941口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,727円																																																											
1万口当たり分配金額	H	16円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,826,543円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,301,166円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円																																																											
収益調整金額	C	105,555,520円																																																											
分配準備積立金額	D	82,497,428円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	189,354,114円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,120,354,268口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,690円																																																											
1万口当たり分配金額	H	16円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,792,566円																																																											
第174期 令和 3年 9月18日 令和 3年10月18日	第180期 令和 4年 3月18日 令和 4年 4月18日																																																												

前期 自 令和 3年 7月20日 至 令和 4年 1月17日				当期 自 令和 4年 1月18日 至 令和 4年 7月19日			
	項目				項目		
	費用控除後の配当等収益額	A	1,585,094円		費用控除後の配当等収益額	A	1,727,771円
	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円		費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
	収益調整金額	C	104,717,061円		収益調整金額	C	106,113,424円
	分配準備積立金額	D	89,445,092円		分配準備積立金額	D	81,824,960円
	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	195,747,247円		当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	189,666,155円
	当ファンドの期末残存口数	F	1,134,239,634口		当ファンドの期末残存口数	F	1,122,588,512口
	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,725円		1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,689円
	1万口当たり分配金額	H	16円		1万口当たり分配金額	H	16円
	収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,814,783円		収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,796,141円
第175期 令和 3年10月19日 令和 3年11月17日				第181期 令和 4年 4月19日 令和 4年 5月17日			
	項目				項目		
	費用控除後の配当等収益額	A	946,564円		費用控除後の配当等収益額	A	933,356円
	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円		費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
	収益調整金額	C	103,850,854円		収益調整金額	C	106,463,165円
	分配準備積立金額	D	87,713,543円		分配準備積立金額	D	81,395,074円
	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	192,510,961円		当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	188,791,595円
	当ファンドの期末残存口数	F	1,120,374,374口		当ファンドの期末残存口数	F	1,122,510,276口
	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,718円		1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,681円
	1万口当たり分配金額	H	16円		1万口当たり分配金額	H	16円
	収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,792,598円		収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,796,016円
第176期 令和 3年11月18日 令和 3年12月17日				第182期 令和 4年 5月18日 令和 4年 6月17日			
	項目				項目		
	費用控除後の配当等収益額	A	883,617円		費用控除後の配当等収益額	A	1,010,058円
	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円		費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
	収益調整金額	C	104,452,885円		収益調整金額	C	107,056,041円
	分配準備積立金額	D	86,418,261円		分配準備積立金額	D	80,285,465円
	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	191,754,763円		当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	188,351,564円
	当ファンドの期末残存口数	F	1,121,247,935口		当ファンドの期末残存口数	F	1,124,571,861口
	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,710円		1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,674円
	1万口当たり分配金額	H	16円		1万口当たり分配金額	H	16円
	収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,793,996円		収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,799,314円
第177期 令和 3年12月18日				第183期 令和 4年 6月18日			

前期 自 令和 3年 7月20日 至 令和 4年 1月17日			当期 自 令和 4年 1月18日 至 令和 4年 7月19日		
令和 4年 1月17日			令和 4年 7月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	908,757円	費用控除後の配当等収益額	A	1,799,750円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	104,500,949円	収益調整金額	C	107,657,050円
分配準備積立金額	D	84,841,371円	分配準備積立金額	D	79,367,355円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	190,251,077円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	188,824,155円
当ファンドの期末残存口数	F	1,117,579,701口	当ファンドの期末残存口数	F	1,127,403,891口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,702円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,674円
1万口当たり分配金額	H	16円	1万口当たり分配金額	H	16円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,788,127円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,803,846円

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	前期 自 令和 3年 7月20日 至 令和 4年 1月17日	当期 自 令和 4年 1月18日 至 令和 4年 7月19日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、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	前期 [令和 4年 1月17日現在]	当期 [令和 4年 7月19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	前期 [令和 4年 1月17日現在]	当期 [令和 4年 7月19日現在]
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	△11,970,417	45,506,821
合計	△11,970,417	45,506,821

（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）

	前期 [令和 4年 1月17日現在]	当期 [令和 4年 7月19日現在]
1口当たり純資産額	0.8966円	0.9189円
(1万口当たり純資産額)	(8,966円)	(9,189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
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	432,575,215	1,035,541,807	
合計		432,575,215	1,035,541,807	

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 7月19日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	1,786,702,267
コール・ローン	416,571,781
国債証券	318,662,052,622
派生商品評価勘定	650,735
未収入金	1,856,614,596
未収利息	1,792,222,211
前払費用	277,879,956
流動資産合計	324,792,694,168
資産合計	324,792,694,168
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	474,270
未払金	635,165,467
未払解約金	157,278,268
未払利息	228
流動負債合計	792,918,233
負債合計	792,918,233
純資産の部	
元本等	
元本	135,341,849,509
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	188,657,926,426
元本等合計	323,999,775,935
純資産合計	323,999,775,935
負債純資産合計	324,792,694,168

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 7月19日現在]
1. 期首	令和 4年 1月18日
期首元本額	127,266,778,509円

	[令和 4年 7月19日現在]
期中追加設定元本額	22,583,961,240円
期中一部解約元本額	14,508,890,240円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）	265,661,186円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）	543,125,248円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）	317,945,942円
三菱UFJ 外国債券オープン	961,661,691円
三菱UFJ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	2,133,347,417円
三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	5,544,399,390円
三菱UFJ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	3,836,485,715円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	555,676,004円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）	89,347,305円
ファンド・マネジャー（海外債券）	1,286,522,392円
eMAXIS 先進国債券インデックス	5,375,311,467円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	2,152,479,142円
eMAXIS バランス（波乗り型）	225,123,141円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	795,705,351円
コアバランス	1,214,926円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	213,409,076円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	114,062,494円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	63,865,041円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	21,372,165,292円
海外債券セレクション（ラップ向け）	4,605,012,085円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	8,014,021,201円
つみたて8資産均等バランス	3,648,089,921円
つみたて4資産均等バランス	1,138,932,335円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	2,278,463円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	665,636円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	107,227円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	108,525,809円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	55,780,124円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	27,820,903円
三菱UFJ DC年金バランス（株式15）	455,321,408円
三菱UFJ DC年金バランス（株式40）	666,492,561円
三菱UFJ DC年金バランス（株式65）	745,520,175円
三菱UFJ DC年金インデックス（先進国債券）	814,230,717円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	28,402,806円

	[令和 4年 7月19日現在]
三菱UFJ DC年金バランス（株式25）	107,420,466円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金）	10,560,455円
ラップ向けインデックスf 先進国債券	2,728,839,843円
三菱UFJ DC年金バランス（株式80）	1,159,411円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	7,985,625円
三菱UFJ 外国債券オープン（確定拠出年金）	2,907,953,982円
ワールド・インカムオープン	1,123,442,708円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	13,896,894,067円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）	432,575,215円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド（年1回決算型）	1,793,932,313円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	550,735,097円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	437,355,895円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	182,637,186円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	134,128,100円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	41,682,432円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	15,728,693円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA（適格機関投資家限定）	1,375,112,970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）	8,440円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2（適格機関投資家限定）	14,824,710円
MUAM 世界債券オープン（適格機関投資家限定）	3,601,313,459円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	18,384,636円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	1,840,748,107円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	1,288,054,301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）	28,093,381,499円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	524,996,131円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	3,272,896円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	818,399円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	1,595,036,932円
アドバンスト・バランスI（FOFs用）（適格機関投資家限定）	70,758,398円
アドバンスト・バランスII（FOFs用）（適格機関投資家限定）	114,207,191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）	25,769,602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）	2,709,375,679円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2（適格機関投資家限定）	112,162,220円
外国債券インデックスファンドV（適格機関投資家限定）	4,243,181円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	1,671,228円

	[令和 4年 7月19日現在]
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	3,787,241円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	1,431,936円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	848,552円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	9,886,815円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	5,893,506円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	11,422,695円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	6,599,174円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	15,972,434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）	112,114,999円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,819,372,460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）	195,406,913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）	536,789,387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）	420,627,246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）	161,429,414円
合計	135,341,849,509円
2. 受益権の総数	135,341,849,509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 4年 1月18日 至 令和 4年 7月19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。

区分	自 令和 4年 1月18日 至 令和 4年 7月19日
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 7月19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 7月19日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△5,135,733,341
合計	△5,135,733,341

(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 7月19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	95,846,934	—	95,386,014	△460,920
	イギリスポンド	9,853,440	—	9,898,956	45,516
	スウェーデンクローネ	3,282,375	—	3,317,425	35,050
	ノルウェークローネ	2,715,400	—	2,733,880	18,480
	デンマーククローネ	3,740,400	—	3,764,060	23,660
	オフショア元	6,142,410	—	6,129,060	△13,350
	ユーロ	69,594,000	—	70,050,150	456,150
	売建				
	アメリカドル	869,518,907	—	869,474,877	44,030
	カナダドル	31,936,800	—	31,936,350	450
	オーストラリアドル	23,536,000	—	23,535,075	925
	イギリスポンド	84,138,780	—	84,137,352	1,428
	シンガポールドル	5,931,600	—	5,931,390	210
	スウェーデンクローネ	5,307,920	—	5,307,760	160
	ノルウェークローネ	4,784,150	—	4,784,045	105
	デンマーククローネ	7,528,400	—	7,528,240	160
	メキシコペソ	13,515,400	—	13,507,800	7,600
	イスラエルシェケル	4,002,130	—	4,002,010	120
	ポーランドズロチ	4,390,695	—	4,388,760	1,935
	ユーロ	608,051,360	—	608,036,604	14,756
	合計	1,853,817,101	—	1,853,849,808	176,465

（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 7月19日現在]
1口当たり純資産額	2.3939円
(1万口当たり純資産額)	(23,939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 230715	5,300,000.00	5,145,761.71	
		0.125 T-NOTE 230731	7,200,000.00	6,981,468.74	
		0.125 T-NOTE 230815	4,500,000.00	4,357,968.75	
		0.125 T-NOTE 230831	7,500,000.00	7,252,441.39	
		0.125 T-NOTE 230915	6,350,000.00	6,126,261.71	
		0.125 T-NOTE 231015	9,200,000.00	8,867,218.75	
		0.125 T-NOTE 231215	8,500,000.00	8,143,398.43	
		0.125 T-NOTE 240115	9,100,000.00	8,696,898.43	
		0.125 T-NOTE 240215	6,800,000.00	6,483,906.25	
		0.25 T-NOTE 231115	6,500,000.00	6,258,789.05	
		0.25 T-NOTE 250630	6,650,000.00	6,107,869.13	
		0.25 T-NOTE 250731	5,800,000.00	5,312,664.05	
		0.25 T-NOTE 250930	5,100,000.00	4,651,359.37	
		0.375 T-NOTE 240415	5,300,000.00	5,047,421.87	
		0.375 T-NOTE 240715	7,700,000.00	7,287,929.68	
		0.375 T-NOTE 240815	7,200,000.00	6,797,812.50	
		0.375 T-NOTE 240915	10,000,000.00	9,418,750.00	
		0.375 T-NOTE 250430	2,670,000.00	2,471,835.93	
		0.375 T-NOTE 251130	10,150,000.00	9,255,531.25	
		0.375 T-NOTE 260131	7,700,000.00	6,992,562.50	
		0.375 T-NOTE 270731	3,500,000.00	3,063,046.87	
		0.375 T-NOTE 270930	8,300,000.00	7,223,593.75	
		0.5 T-NOTE 250331	2,000,000.00	1,862,343.75	
		0.5 T-NOTE 270430	7,780,000.00	6,891,985.93	

0.5 T-NOTE 270531	4,280,000.00	3,781,446.87	
0.5 T-NOTE 270630	3,600,000.00	3,173,906.25	
0.5 T-NOTE 270831	4,950,000.00	4,347,492.18	
0.625 T-NOTE 241015	7,400,000.00	6,995,890.62	
0.625 T-NOTE 260731	7,930,000.00	7,187,801.56	
0.625 T-NOTE 270331	1,800,000.00	1,607,484.37	
0.625 T-NOTE 271231	9,630,000.00	8,442,801.56	
0.625 T-NOTE 300515	9,190,000.00	7,686,932.40	
0.625 T-NOTE 300815	12,260,000.00	10,204,534.37	
0.75 T-NOTE 241115	6,700,000.00	6,338,304.68	
0.75 T-NOTE 260331	15,950,000.00	14,637,863.28	
0.75 T-NOTE 260430	5,600,000.00	5,128,812.49	
0.75 T-NOTE 260531	8,200,000.00	7,495,953.12	
0.75 T-NOTE 260831	5,500,000.00	5,000,703.12	
0.75 T-NOTE 280131	8,050,000.00	7,097,835.93	
0.875 T-NOTE 260630	8,300,000.00	7,613,953.12	
0.875 T-NOTE 260930	10,000,000.00	9,125,781.25	
0.875 T-NOTE 301115	12,980,000.00	10,989,395.31	
1 T-NOTE 241215	8,000,000.00	7,598,125.00	
1 T-NOTE 280731	3,150,000.00	2,788,857.41	
1.125 T-BOND 400515	3,070,000.00	2,153,317.17	
1.125 T-BOND 400815	6,170,000.00	4,292,488.28	
1.125 T-NOTE 250115	6,000,000.00	5,706,796.87	
1.125 T-NOTE 250228	4,150,000.00	3,939,582.03	
1.125 T-NOTE 261031	5,900,000.00	5,433,531.25	
1.125 T-NOTE 270228	2,950,000.00	2,700,632.81	
1.125 T-NOTE 280229	6,200,000.00	5,576,851.55	
1.125 T-NOTE 280831	5,400,000.00	4,811,062.50	
1.125 T-NOTE 310215	12,380,000.00	10,680,651.55	
1.25 T-BOND 500515	6,930,000.00	4,441,155.46	
1.25 T-NOTE 230731	5,830,000.00	5,719,776.56	
1.25 T-NOTE 261130	7,300,000.00	6,755,921.87	
1.25 T-NOTE 261231	8,200,000.00	7,576,031.25	
1.25 T-NOTE 280331	9,950,000.00	8,995,421.87	
1.25 T-NOTE 280430	2,500,000.00	2,256,445.31	
1.25 T-NOTE 280531	2,700,000.00	2,433,269.52	
1.25 T-NOTE 280630	8,480,000.00	7,632,993.74	
1.25 T-NOTE 280930	8,000,000.00	7,171,875.00	
1.25 T-NOTE 310815	14,130,000.00	12,225,761.70	
1.375 T-BOND 401115	6,700,000.00	4,855,406.25	
1.375 T-BOND 500815	7,900,000.00	5,234,984.36	
1.375 T-NOTE 230630	2,900,000.00	2,853,101.56	
	6,550,000.00	6,420,535.15	

1.375 T-NOTE 230831			
1.375 T-NOTE 230930	6,450,000.00	6,314,953.12	
1.375 T-NOTE 250131	5,320,000.00	5,088,912.50	
1.375 T-NOTE 281031	5,400,000.00	4,873,500.00	
1.375 T-NOTE 281231	7,400,000.00	6,676,765.62	
1.375 T-NOTE 311115	13,900,000.00	12,119,062.50	
1.5 T-NOTE 240930	6,000,000.00	5,785,312.50	
1.5 T-NOTE 241031	4,100,000.00	3,950,734.37	
1.5 T-NOTE 241130	3,930,000.00	3,781,089.84	
1.5 T-NOTE 250215	4,500,000.00	4,313,496.09	
1.5 T-NOTE 260815	8,040,000.00	7,540,640.62	
1.5 T-NOTE 270131	6,940,000.00	6,475,887.50	
1.5 T-NOTE 281130	7,650,000.00	6,951,339.84	
1.5 T-NOTE 300215	6,940,000.00	6,243,831.25	
1.625 T-BOND 501115	8,170,000.00	5,781,551.56	
1.625 T-NOTE 231031	5,470,000.00	5,361,027.34	
1.625 T-NOTE 260215	7,260,000.00	6,886,790.62	
1.625 T-NOTE 260515	6,970,000.00	6,591,550.78	
1.625 T-NOTE 261031	2,450,000.00	2,306,445.31	
1.625 T-NOTE 261130	3,400,000.00	3,196,796.87	
1.625 T-NOTE 290815	8,450,000.00	7,706,664.06	
1.625 T-NOTE 310515	11,950,000.00	10,721,390.62	
1.75 T-BOND 410815	8,530,000.00	6,512,788.26	
1.75 T-NOTE 240731	5,150,000.00	5,007,570.31	
1.75 T-NOTE 241231	3,350,000.00	3,238,769.53	
1.75 T-NOTE 250315	7,200,000.00	6,939,000.00	
1.75 T-NOTE 261231	4,300,000.00	4,064,843.75	
1.75 T-NOTE 290131	6,000,000.00	5,539,218.74	
1.75 T-NOTE 291115	1,450,000.00	1,332,867.18	
1.875 T-BOND 410215	8,100,000.00	6,394,570.31	
1.875 T-BOND 510215	9,010,000.00	6,803,957.81	
1.875 T-BOND 511115	8,230,000.00	6,212,364.05	
1.875 T-NOTE 270228	7,700,000.00	7,305,976.56	
1.875 T-NOTE 290228	5,800,000.00	5,397,398.43	
1.875 T-NOTE 320215	12,300,000.00	11,194,441.37	
2 T-BOND 411115	7,320,000.00	5,835,984.37	
2 T-BOND 500215	6,440,000.00	5,023,703.12	
2 T-BOND 510815	8,850,000.00	6,885,714.84	
2 T-NOTE 240430	3,600,000.00	3,527,156.25	
2 T-NOTE 240531	11,730,000.00	11,482,570.31	
2 T-NOTE 240630	7,000,000.00	6,847,421.87	
2 T-NOTE 250215	8,110,000.00	7,877,471.09	
2 T-NOTE 250815	3,790,000.00	3,660,014.83	

2 T-NOTE 261115	5,400,000.00	5,157,421.87	
2.125 T-NOTE 231130	3,300,000.00	3,254,109.37	
2.125 T-NOTE 240229	7,550,000.00	7,426,132.81	
2.125 T-NOTE 240331	10,160,000.00	9,982,993.75	
2.125 T-NOTE 240731	3,450,000.00	3,379,113.28	
2.125 T-NOTE 240930	3,300,000.00	3,229,617.18	
2.125 T-NOTE 241130	1,900,000.00	1,856,062.50	
2.125 T-NOTE 250515	7,770,000.00	7,550,254.68	
2.125 T-NOTE 260531	5,000,000.00	4,820,703.12	
2.25 T-BOND 410515	7,290,000.00	6,114,487.50	
2.25 T-BOND 460815	3,930,000.00	3,175,931.25	
2.25 T-BOND 490815	5,000,000.00	4,126,562.49	
2.25 T-BOND 520215	7,690,000.00	6,364,075.73	
2.25 T-NOTE 231231	4,190,000.00	4,137,297.65	
2.25 T-NOTE 240131	8,750,000.00	8,633,789.06	
2.25 T-NOTE 240430	7,600,000.00	7,479,468.75	
2.25 T-NOTE 241031	4,800,000.00	4,707,750.00	
2.25 T-NOTE 241115	4,950,000.00	4,852,933.58	
2.25 T-NOTE 241231	2,600,000.00	2,544,546.87	
2.25 T-NOTE 251115	7,390,000.00	7,177,826.16	
2.25 T-NOTE 270215	7,890,000.00	7,601,521.87	
2.25 T-NOTE 270815	4,690,000.00	4,503,865.62	
2.25 T-NOTE 271115	8,090,000.00	7,751,231.25	
2.375 T-BOND 420215	5,090,000.00	4,328,885.92	
2.375 T-BOND 491115	4,650,000.00	3,948,867.18	
2.375 T-BOND 510515	8,840,000.00	7,505,021.86	
2.375 T-NOTE 240229	3,750,000.00	3,703,417.96	
2.375 T-NOTE 240815	6,390,000.00	6,286,162.50	
2.375 T-NOTE 270515	5,710,000.00	5,524,425.00	
2.375 T-NOTE 290331	5,600,000.00	5,365,281.23	
2.375 T-NOTE 290515	5,000,000.00	4,789,843.75	
2.5 T-BOND 450215	3,350,000.00	2,850,640.62	
2.5 T-BOND 460215	3,450,000.00	2,936,273.43	
2.5 T-BOND 460515	3,130,000.00	2,663,678.90	
2.5 T-NOTE 230815	7,900,000.00	7,845,070.31	
2.5 T-NOTE 240131	6,400,000.00	6,334,500.00	
2.5 T-NOTE 240515	9,100,000.00	8,991,226.56	
2.5 T-NOTE 240531	6,000,000.00	5,922,187.50	
2.5 T-NOTE 250131	3,350,000.00	3,295,039.06	
2.5 T-NOTE 260228	3,450,000.00	3,372,105.46	
2.5 T-NOTE 270331	5,500,000.00	5,361,425.77	
2.625 T-NOTE 250331	1,960,000.00	1,931,671.87	

2.625 T-NOTE 250415	4,000,000.00	3,942,500.00
2.625 T-NOTE 251231	2,300,000.00	2,260,468.75
2.625 T-NOTE 260131	4,800,000.00	4,717,875.00
2.625 T-NOTE 270531	2,500,000.00	2,450,292.96
2.625 T-NOTE 290215	6,910,000.00	6,728,612.50
2.75 T-BOND 420815	1,720,000.00	1,547,731.25
2.75 T-BOND 421115	2,200,000.00	1,977,078.12
2.75 T-BOND 470815	4,110,000.00	3,681,982.01
2.75 T-BOND 471115	3,710,000.00	3,330,884.37
2.75 T-NOTE 230731	700,000.00	697,375.00
2.75 T-NOTE 231115	13,040,000.00	12,977,856.25
2.75 T-NOTE 240215	8,260,000.00	8,206,439.06
2.75 T-NOTE 250228	3,440,000.00	3,403,718.75
2.75 T-NOTE 250515	6,400,000.00	6,326,749.99
2.75 T-NOTE 250630	2,370,000.00	2,343,152.34
2.75 T-NOTE 250831	8,250,000.00	8,142,363.28
2.75 T-NOTE 270430	3,800,000.00	3,743,890.62
2.75 T-NOTE 280215	8,490,000.00	8,340,098.43
2.75 T-NOTE 290531	4,600,000.00	4,513,031.24
2.875 T-BOND 430515	3,430,000.00	3,133,358.59
2.875 T-BOND 450815	2,800,000.00	2,552,593.75
2.875 T-BOND 461115	1,820,000.00	1,663,167.18
2.875 T-BOND 490515	5,750,000.00	5,387,929.68
2.875 T-BOND 520515	4,830,000.00	4,588,500.00
2.875 T-NOTE 230930	4,150,000.00	4,137,031.25
2.875 T-NOTE 231031	3,700,000.00	3,686,703.12
2.875 T-NOTE 250430	6,000,000.00	5,951,484.37
2.875 T-NOTE 250531	4,230,000.00	4,193,648.43
2.875 T-NOTE 250615	7,800,000.00	7,736,625.00
2.875 T-NOTE 251130	3,800,000.00	3,765,710.93
2.875 T-NOTE 280515	12,490,000.00	12,346,072.25
2.875 T-NOTE 280815	11,510,000.00	11,370,621.09
2.875 T-NOTE 290430	7,000,000.00	6,922,070.30
2.875 T-NOTE 320515	7,550,000.00	7,496,324.21
3 T-BOND 420515	2,570,000.00	2,417,607.03
3 T-BOND 441115	3,370,000.00	3,133,310.15
3 T-BOND 450515	1,790,000.00	1,665,539.06
3 T-BOND 451115	800,000.00	746,125.00
3 T-BOND 470215	3,460,000.00	3,236,721.87
3 T-BOND 470515	2,790,000.00	2,610,829.68
3 T-BOND 480215	4,680,000.00	4,423,696.87
3 T-BOND 480815	5,360,000.00	5,085,718.75
3 T-BOND 490215	5,790,000.00	5,540,306.25

		3 T-NOTE 250930	4,600,000.00	4,577,539.06	
		3 T-NOTE 251031	8,300,000.00	8,257,527.33	
		3.125 T-BOND 411115	1,990,000.00	1,918,095.70	
		3.125 T-BOND 420215	1,600,000.00	1,538,875.00	
		3.125 T-BOND 430215	2,150,000.00	2,046,699.20	
		3.125 T-BOND 440815	2,680,000.00	2,545,790.62	
		3.125 T-BOND 480515	4,410,000.00	4,281,145.31	
		3.125 T-NOTE 281115	7,740,000.00	7,756,326.56	
		3.25 T-BOND 420515	2,830,000.00	2,770,083.57	
		3.375 T-BOND 440515	2,760,000.00	2,730,028.12	
		3.375 T-BOND 481115	5,430,000.00	5,538,175.78	
		3.5 T-BOND 390215	460,000.00	484,653.12	
		3.625 T-BOND 430815	3,100,000.00	3,189,125.00	
		3.625 T-BOND 440215	3,090,000.00	3,177,630.46	
		3.75 T-BOND 410815	1,560,000.00	1,649,578.12	
		3.75 T-BOND 431115	2,630,000.00	2,753,692.18	
		3.875 T-BOND 400815	1,610,000.00	1,749,114.06	
		4.25 T-BOND 390515	2,190,000.00	2,516,960.14	
		4.25 T-BOND 401115	2,200,000.00	2,504,734.37	
		4.375 T-BOND 391115	1,930,000.00	2,245,283.59	
		4.375 T-BOND 400515	1,630,000.00	1,893,092.18	
		4.375 T-BOND 410515	1,510,000.00	1,741,926.56	
		4.5 T-BOND 360215	1,000,000.00	1,183,671.87	
		4.5 T-BOND 380515	730,000.00	867,730.46	
		4.5 T-BOND 390815	1,630,000.00	1,928,621.09	
		4.625 T-BOND 400215	1,670,000.00	2,002,303.90	
		4.75 T-BOND 410215	2,000,000.00	2,427,812.50	
		5 T-BOND 370515	770,000.00	958,770.31	
		5.25 T-BOND 281115	1,530,000.00	1,719,457.03	
		5.375 T-BOND 310215	1,010,000.00	1,190,616.40	
		6 T-BOND 260215	1,900,000.00	2,081,316.40	
		6.125 T-BOND 271115	3,860,000.00	4,426,032.81	
		6.25 T-BOND 300515	1,150,000.00	1,408,660.15	
アメリカドル合計			1,273,240,000.00	1,183,530,119.08 (163,623,038,962)	
カナダドル	国債証券	0.25 CAN GOVT 240401	3,850,000.00	3,663,837.10	
		0.25 CAN GOVT 260301	2,200,000.00	1,986,703.40	
		0.5 CAN GOVT 250901	800,000.00	737,888.00	
		0.5 CAN GOVT 301201	5,400,000.00	4,367,822.40	
		1 CAN GOVT 270601	1,930,000.00	1,752,580.89	
		1.25 CAN GOVT 250301	2,100,000.00	1,998,851.40	
		1.25 CAN GOVT 270301	2,500,000.00	2,304,360.00	

		1.25 CAN GOVT 300601	3,510,000.00	3,060,442.71	
		1.5 CAN GOVT 240901	2,000,000.00	1,931,752.00	
		1.5 CAN GOVT 250401	1,000,000.00	956,534.00	
		1.5 CAN GOVT 260601	3,200,000.00	3,016,956.80	
		1.5 CAN GOVT 310601	4,400,000.00	3,856,877.20	
		1.5 CAN GOVT 311201	2,350,000.00	2,048,842.80	
		1.75 CAN GOVT 531201	2,550,000.00	1,887,663.00	
		2 CAN GOVT 230901	3,000,000.00	2,957,610.00	
		2 CAN GOVT 280601	500,000.00	471,875.50	
		2 CAN GOVT 320601	1,650,000.00	1,499,320.35	
		2 CAN GOVT 511201	4,660,000.00	3,715,487.90	
		2.25 CAN GOVT 240301	2,150,000.00	2,117,679.05	
		2.25 CAN GOVT 250601	3,100,000.00	3,025,689.90	
		2.25 CAN GOVT 290601	2,210,000.00	2,100,008.30	
		2.5 CAN GOVT 240601	2,700,000.00	2,666,700.90	
		2.75 CAN GOVT 481201	1,380,000.00	1,299,210.66	
		2.75 CANADA GOVER 641201	800,000.00	743,391.20	
		3.5 CAN GOVT 451201	1,460,000.00	1,552,431.14	
		4 CAN GOVT 410601	800,000.00	895,199.20	
		5 CAN GOVT 370601	770,000.00	934,919.37	
		5.75 CAN GOVT 290601	1,450,000.00	1,689,609.60	
		5.75 CAN GOVT 330601	1,050,000.00	1,303,111.95	
カナダドル合計			65,470,000.00	60,543,356.72 (6,446,051,189)	
オーストラリアドル	国債証券	0.25 AUST GOVT 241121	900,000.00	846,792.60	
		0.25 AUST GOVT 251121	3,450,000.00	3,137,140.44	
		0.5 AUST GOVT 260921	1,100,000.00	985,833.22	
		1 AUST GOVT 301221	1,610,000.00	1,327,835.59	
		1 AUST GOVT 311121	3,610,000.00	2,913,424.76	
		1.25 AUST GOVT 320521	3,100,000.00	2,538,463.70	
		1.5 AUST GOVT 310621	2,590,000.00	2,208,997.53	
		1.75 AUST GOVT 321121	2,780,000.00	2,369,748.86	
		1.75 AUST GOVT 510621	1,990,000.00	1,318,215.83	
		2.25 AUST GOVT 280521	1,250,000.00	1,184,095.45	
		2.5 AUST GOVT 300521	3,940,000.00	3,705,133.21	
		2.75 AUST GOVT 271121	2,090,000.00	2,041,037.36	
		2.75 AUST GOVT 281121	1,630,000.00	1,581,609.89	
		2.75 AUST GOVT 291121	2,210,000.00	2,125,746.09	
		2.75 AUST GOVT 350621	960,000.00	880,249.36	
		2.75 AUST GOVT 410521	1,370,000.00	1,199,607.98	
		3 AUST GOVT 331121	1,900,000.00	1,812,790.38	
		3 AUST GOVT 470321	1,560,000.00	1,392,074.68	

		3.25 AUST GOVT 250421	4,760,000.00	4,787,063.45	
		3.25 AUST GOVT 290421	2,260,000.00	2,253,348.02	
		3.25 AUST GOVT 390621	1,640,000.00	1,558,705.62	
		3.75 AUST GOVT 370421	1,300,000.00	1,322,118.46	
		4.25 AUST GOVT 260421	3,320,000.00	3,448,280.15	
		4.5 AUST GOVT 330421	2,210,000.00	2,414,998.93	
		4.75 AUST GOVT 270421	2,050,000.00	2,190,594.74	
オーストラリアドル合計			55,580,000.00	51,543,906.30 (4,852,858,778)	
イギリス ポンド	国債証券	0.125 GILT 240131	4,500,000.00	4,362,075.00	
		0.125 GILT 260130	1,100,000.00	1,036,457.10	
		0.125 GILT 280131	400,000.00	363,260.00	
		0.25 GILT 250131	3,600,000.00	3,436,272.00	
		0.25 GILT 310731	2,660,000.00	2,250,915.40	
		0.375 GILT 261022	1,900,000.00	1,779,828.80	
		0.375 GILT 301022	1,690,000.00	1,478,969.70	
		0.5 GILT 290131	1,250,000.00	1,136,673.91	
		0.5 GILT 611022	1,420,000.00	711,878.94	
		0.625 GILT 250607	1,380,000.00	1,332,735.00	
		0.625 GILT 350731	2,440,000.00	1,921,487.94	
		0.625 GILT 501022	1,240,000.00	751,682.54	
		0.875 GILT 291022	2,060,000.00	1,908,071.70	
		0.875 GILT 330731	1,020,000.00	877,703.95	
		0.875 GILT 460131	970,000.00	668,322.62	
		1 GILT 240422	1,700,000.00	1,671,972.44	
		1 GILT 320131	500,000.00	448,050.00	
		1.125 GILT 390131	1,610,000.00	1,281,994.70	
		1.125 GILT 731022	920,000.00	565,809.20	
		1.25 GILT 270722	1,770,000.00	1,718,935.50	
		1.25 GILT 411022	2,630,000.00	2,072,440.00	
		1.25 GILT 510731	1,470,000.00	1,061,422.32	
		1.5 GILT 260722	2,290,000.00	2,257,390.40	
		1.5 GILT 470722	2,110,000.00	1,663,005.12	
		1.5 GILT 530731	200,000.00	152,623.10	
		1.625 GILT 281022	1,540,000.00	1,517,623.80	
		1.625 GILT 541022	1,530,000.00	1,201,575.70	
		1.625 GILT 711022	1,530,000.00	1,154,507.40	
		1.75 GILT 370907	2,210,000.00	1,970,725.51	
		1.75 GILT 490122	1,180,000.00	981,387.12	
		1.75 GILT 570722	2,130,000.00	1,717,129.32	
		2 GILT 250907	1,760,000.00	1,764,928.00	
		2.5 GILT 650722	2,060,000.00	2,042,490.00	

		2.75 GILT 240907	1,900,000.00	1,930,777.72	
		3.25 GILT 440122	2,360,000.00	2,571,479.60	
		3.5 GILT 450122	2,480,000.00	2,812,568.00	
		3.5 GILT 680722	1,700,000.00	2,138,940.00	
		3.75 GILT 520722	1,930,000.00	2,372,124.40	
		4 GILT 600122	1,490,000.00	1,997,196.00	
		4.25 GILT 271207	2,320,000.00	2,590,744.00	
		4.25 GILT 320607	2,350,000.00	2,788,340.80	
		4.25 GILT 360307	1,750,000.00	2,089,892.70	
		4.25 GILT 390907	1,450,000.00	1,763,229.00	
		4.25 GILT 401207	1,590,000.00	1,949,296.75	
		4.25 GILT 461207	2,020,000.00	2,573,924.40	
		4.25 GILT 491207	1,510,000.00	1,966,867.41	
		4.25 GILT 551207	1,890,000.00	2,570,345.56	
		4.5 GILT 340907	1,630,000.00	1,987,687.20	
		4.5 GILT 421207	2,250,000.00	2,885,535.00	
		4.75 GILT 301207	2,330,000.00	2,824,826.76	
		4.75 GILT 381207	1,730,000.00	2,219,017.71	
		5 GILT 250307	2,070,000.00	2,231,681.49	
		6 GILT 281207	1,540,000.00	1,915,538.24	
イギリスポンド合計			95,060,000.00	95,440,356.97 (15,746,704,496)	
シンガ ポールド ル	国債証券	1.25 SINGAPORGOVT 261101	700,000.00	658,700.00	
		1.625 SINGAPORGOV 310701	450,000.00	408,555.67	
		1.875 SINGAPORGOV 500301	700,000.00	553,000.00	
		1.875 SINGAPORGOV 511001	950,000.00	757,454.00	
		2.125 SINGAPORGOV 260601	1,530,000.00	1,497,564.00	
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	830,000.00	769,978.55	
		2.375 SINGAPORGOV 250601	600,000.00	594,120.00	
		2.375 SINGAPORGOV 390701	380,000.00	351,880.00	
		2.625 SINGAPORGOV 280501	800,000.00	796,000.00	
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	1,000,000.00	999,411.54	
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	380,000.00	367,868.50	
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	790,000.00	752,870.00	
		2.875 SINGAPORGOV 290701	920,000.00	926,900.00	
		2.875SINGAPORGOVT 300901	1,140,000.00	1,147,410.00	
		3 SINGAPORGOVT 240901	1,500,000.00	1,507,792.50	
		3.375 SINGAPORGOV 330901	780,000.00	819,000.00	
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	760,000.00	785,551.20	
シンガポールドル合計			14,210,000.00	13,694,055.96 (1,353,931,312)	
	国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	1,800,000.00	1,609,979.68	

マレーシア アリン ギット		3.502MALAYSIAGOV 270531	1,400,000.00	1,384,036.68	
		3.733 MALAYSIAGO 280615	2,800,000.00	2,775,472.75	
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	3,230,000.00	2,908,196.90	
		3.8 MALAYSIAGOV 230817	1,950,000.00	1,965,348.25	
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	2,300,000.00	2,193,067.13	
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	1,400,000.00	1,358,387.22	
		3.882 MALAYSIAGOV 250314	1,310,000.00	1,322,697.43	
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	2,000,000.00	1,984,331.18	
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	1,500,000.00	1,509,730.80	
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	1,540,000.00	1,550,916.59	
		3.9 MALAYSIAGOV 261130	2,500,000.00	2,518,903.00	
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	1,400,000.00	1,410,960.18	
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3,920,000.00	3,948,193.81	
		4.065 MALAYSIAGOV 500615	950,000.00	845,223.54	
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4,100,000.00	4,170,412.17	
		4.232MALAYSIAGOV 310630	3,050,000.00	3,082,111.92	
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	2,150,000.00	2,121,395.08	
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	900,000.00	922,027.32	
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	2,240,000.00	2,304,645.50	
		4.642 MALAYSIAGOV 331107	1,200,000.00	1,230,945.36	
		4.736 MALAYSIAGOV 460315	1,650,000.00	1,623,599.93	
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	2,940,000.00	3,052,601.11	
		4.893 MALAYSIAGOV 380608	950,000.00	983,697.07	
		4.921 MALAYSIAGOV 480706	2,020,000.00	2,041,428.36	
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	2,200,000.00	2,272,180.46	
マレーシアリングット合計			53,400,000.00	53,090,489.42 (1,647,297,014)	
スウェー デンク ローネ	国債証券	0.125 SWD GOVT 310512	7,850,000.00	6,909,854.71	
		0.75 SWD GOVT 280512	6,900,000.00	6,551,611.61	
		0.75 SWD GOVT 291112	6,300,000.00	5,916,871.17	
		1 SWD GOVT 261112	10,460,000.00	10,134,706.55	
		1.5 SWD GOVT 231113	9,940,000.00	9,903,986.58	
		2.25 SWD GOVT 320601	6,750,000.00	7,177,612.50	
		2.5 SWD GOVT 250512	8,260,000.00	8,385,642.03	
		3.5 SWD GOVT 390330	5,470,000.00	6,986,201.95	
スウェーデンクローネ合計			61,930,000.00	61,966,487.10 (822,295,283)	
ノル ウェー クローネ	国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	3,500,000.00	3,024,448.00	
		1.375 NORWE GOVT 300819	7,570,000.00	6,716,785.30	
		1.5 NORWE GOVT 260219	4,860,000.00	4,630,083.12	
		1.75 NORWE GOVT 250313	8,950,000.00	8,687,979.80	
		1.75 NORWE GOVT 270217	4,170,000.00	3,966,382.65	

		1.75 NORWE GOVT 290906	4,200,000.00	3,878,511.00	
		2 NORWE GOVT 280426	6,200,000.00	5,897,192.00	
		2.125 NORWE GOVT 320518	3,000,000.00	2,776,800.00	
		3 NORWE GOVT 240314	6,300,000.00	6,318,411.75	
ノルウェークローネ合計			48,750,000.00	45,896,593.62 (627,406,434)	
デンマーククローネ	国債証券	0 DMK GOVT 241115	2,300,000.00	2,258,600.00	
		0 DMK GOVT 311115	7,500,000.00	6,515,047.80	
		0.25 DMK GOVT 521115	6,300,000.00	4,062,996.00	
		0.5 DMK GOVT 271115	9,050,000.00	8,719,738.35	
		0.5 DMK GOVT 291115	10,550,000.00	9,906,239.00	
		1.5 DMK GOVT 231115	3,250,000.00	3,294,954.00	
		1.75 DMK GOVT 251115	7,490,000.00	7,691,203.87	
		4.5 DMK GOVT 391115	13,840,000.00	19,386,476.88	
デンマーククローネ合計			60,280,000.00	61,835,255.90 (1,163,739,516)	
メキシコペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	47,950,000.00	48,364,513.36	
		10 MEXICAN BONOS 361120	11,150,000.00	11,880,516.78	
		5 MEXICAN BONOS 250306	14,000,000.00	12,535,243.14	
		5.5 MEXICAN BONOS 270304	13,000,000.00	11,154,650.00	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	57,900,000.00	51,514,240.84	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	40,250,000.00	37,546,688.04	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	39,350,000.00	36,193,343.00	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	11,200,000.00	10,052,000.00	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	23,890,000.00	20,447,451.00	
		8 MEXICAN BONOS 231207	26,430,000.00	25,852,930.55	
		8 MEXICAN BONOS 240905	12,000,000.00	11,629,200.00	
		8 MEXICAN BONOS 471107	29,900,000.00	26,126,973.71	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	35,050,000.00	33,966,416.98	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	25,700,000.00	23,915,061.75	
メキシコペソ合計			387,770,000.00	361,179,229.15 (2,440,740,876)	
イスラエルシェケル	国債証券	0.5 ISRAEL FIXED 250430	4,000,000.00	3,815,000.00	
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	2,800,000.00	2,509,220.00	
		1.5 ISRAEL FIXED 370531	2,400,000.00	1,990,920.00	
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	4,180,000.00	4,226,398.00	
		3.75 ISRAEL FIXED 240331	6,250,000.00	6,494,375.00	
		3.75 ISRAEL FIXED 470331	2,800,000.00	3,059,840.00	
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	2,580,000.00	3,549,177.00	
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	5,000,000.00	6,001,250.00	
イスラエルシェケル合計			30,010,000.00	31,646,180.00 (1,266,521,263)	
	国債証券	0.25 POLAND 261025	3,000,000.00	2,275,050.00	

ポーランド ズロチ		1.25 POLAND 301025	4,090,000.00	2,736,619.00	
		1.75 POLAND 320425	1,000,000.00	659,000.00	
		2.25 POLAND 241025	4,000,000.00	3,576,200.00	
		2.5 POLAND 240425	2,600,000.00	2,394,210.00	
		2.5 POLAND 260725	6,540,000.00	5,513,056.50	
		2.5 POLAND 270725	5,190,000.00	4,230,109.50	
		2.75 POLAND 280425	4,760,000.00	3,874,997.00	
		2.75 POLAND 291025	4,900,000.00	3,818,325.00	
		3.25 POLAND 250725	7,300,000.00	6,540,070.00	
		4 POLAND 231025	4,300,000.00	4,141,476.20	
		5.75 POLAND 290425	3,450,000.00	3,284,745.00	
ポーランドズロチ合計			51,130,000.00	43,043,858.20 (1,259,949,686)	
中国元	国債証券	1.99 CHINA GOVT 250409	20,000,000.00	19,791,200.00	
		2.36 CHINA GOVT 230702	11,000,000.00	11,047,712.50	
		2.37 CHINA GOVT 270120	11,000,000.00	10,913,540.00	
		2.47 CHINA GOVT 240902	13,000,000.00	13,051,285.00	
		2.56 CHINA GOVT 231021	10,000,000.00	10,061,247.00	
		2.68 CHINA GOVT 300521	6,000,000.00	5,931,910.26	
		2.69 CHINA GOVT 260812	15,000,000.00	15,095,845.50	
		2.75 CHINA GOVT 320217	4,000,000.00	3,975,180.00	
		2.76 CHINA GOVT 320515	4,000,000.00	3,991,700.00	
		2.8 CHINA GOVT 290324	6,000,000.00	6,014,430.00	
		2.85 CHINA GOVT 270604	6,000,000.00	6,075,180.00	
		2.89 CHINA GOVT 311118	5,000,000.00	5,023,223.50	
		2.9 CHINA GOVT 260505	6,000,000.00	6,085,962.60	
		2.91 CHINA GOVT 281014	6,000,000.00	6,063,330.00	
		2.94 CHINA GOVT 241017	7,000,000.00	7,099,679.30	
		3.01 CHINA GOVT 280513	6,000,000.00	6,102,336.00	
		3.02 CHINA GOVT 251022	12,000,000.00	12,226,768.80	
		3.02 CHINA GOVT 310527	14,000,000.00	14,202,650.00	
		3.03 CHINA GOVT 260311	8,000,000.00	8,152,612.00	
		3.12 CHINA GOVT 261205	10,000,000.00	10,241,815.00	
		3.13 CHINA GOVT 291121	7,000,000.00	7,155,456.70	
		3.25 CHINA GOVT 260606	10,000,000.00	10,279,613.00	
		3.25 CHINA GOVT 281122	8,000,000.00	8,248,502.40	
		3.27 CHINA GOVT 301119	13,000,000.00	13,443,827.80	
		3.28 CHINA GOVT 271203	7,000,000.00	7,239,521.10	
		3.29 CHINA GOVT 290523	9,000,000.00	9,312,312.60	
		3.32 CHINA GOVT 520415	1,000,000.00	1,008,700.70	
		3.39 CHINA GOVT 500316	12,000,000.00	12,076,453.20	
		3.53 CHINA GOVT 511018	4,000,000.00	4,159,360.00	

		3.54 CHINA GOVT 280816	4,000,000.00	4,211,969.20	
		3.57 CHINA GOVT 240622	10,000,000.00	10,275,872.00	
		3.59 CHINA GOVT 270803	7,000,000.00	7,378,073.50	
		3.6 CHINA GOVT 250906	12,000,000.00	12,468,332.40	
		3.61 CHINA GOVT 250607	10,000,000.00	10,371,354.00	
		3.69 CHINA GOVT 280517	5,000,000.00	5,309,704.50	
		3.72 CHINA GOVT 510412	4,000,000.00	4,277,648.80	
		3.77 CHINA GOVT 250308	11,000,000.00	11,442,558.60	
		3.81 CHINA GOVT 500914	8,000,000.00	8,685,604.00	
		3.86 CHINA GOVT 490722	6,000,000.00	6,554,279.40	
		4.08 CHINA GOVT 230822	12,000,000.00	12,308,568.00	
		4.08 CHINA GOVT 481022	5,000,000.00	5,663,884.50	
中国元合計			345,000,000.00	353,019,203.86 (7,236,152,338)	
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 250420	800,000.00	784,284.00	
		0 AUSTRIA GOVT 281020	400,000.00	366,682.00	
		0 AUSTRIA GOVT 300220	1,450,000.00	1,294,609.30	
		0 AUSTRIA GOVT 310220	1,650,000.00	1,432,629.27	
		0 AUSTRIA GOVT 401020	550,000.00	372,702.00	
		0 BEL GOVT 271022	500,000.00	469,482.00	
		0 BEL GOVT 311022	1,700,000.00	1,454,370.40	
		0 BUND 260815	4,880,000.00	4,742,188.80	
		0 BUND 271115	2,500,000.00	2,387,657.50	
		0 BUND 290815	990,000.00	924,789.69	
		0 BUND 300215	2,120,000.00	1,966,454.76	
		0 BUND 300815	4,960,000.00	4,565,531.20	
		0 BUND 310215	1,200,000.00	1,095,728.40	
		0 BUND 310815	5,200,000.00	4,708,750.80	
		0 BUND 320215	2,550,000.00	2,285,046.00	
		0 BUND 350515	3,980,000.00	3,354,976.82	
		0 BUND 360515	1,520,000.00	1,259,338.24	
		0 BUND 500815	4,390,000.00	2,958,759.03	
		0 BUND 500815	780,000.00	527,753.46	
		0 BUND 520815	1,750,000.00	1,141,325.50	
		0 FINNISH GOVT 240915	850,000.00	838,649.95	
		0 FINNISH GOVT 300915	750,000.00	662,388.00	
		0 IRISH GOVT 311018	350,000.00	299,242.65	
		0 ITALY GOVT 240815	2,500,000.00	2,420,806.42	
		0 ITALY GOVT 260401	2,300,000.00	2,122,670.00	
		0 ITALY GOVT 260801	1,600,000.00	1,461,216.00	
		0 NETH GOVT 240115	2,540,000.00	2,523,660.18	
		0 NETH GOVT 270115	1,350,000.00	1,288,993.16	

0 NETH GOVT 290115	500,000.00	460,692.50	
0 NETH GOVT 300715	2,650,000.00	2,383,900.25	
0 NETH GOVT 380115	1,140,000.00	868,573.98	
0 NETH GOVT 520115	1,690,000.00	1,014,745.29	
0 O.A.T 240325	6,000,000.00	5,954,058.00	
0 O.A.T 250225	3,200,000.00	3,130,537.08	
0 O.A.T 250325	5,080,000.00	4,972,649.44	
0 O.A.T 260225	4,600,000.00	4,445,913.80	
0 O.A.T 270225	5,700,000.00	5,407,236.60	
0 O.A.T 291125	5,180,000.00	4,659,228.70	
0 O.A.T 301125	6,190,000.00	5,432,736.00	
0 O.A.T 311125	5,500,000.00	4,716,838.50	
0 O.A.T 320525	3,800,000.00	3,210,965.80	
0 OBL 241018	4,400,000.00	4,349,598.00	
0 OBL 250411	1,100,000.00	1,083,109.68	
0 OBL 260410	900,000.00	877,716.90	
0 OBL 261009	2,900,000.00	2,806,170.50	
0 OBL 270416	1,900,000.00	1,827,347.80	
0 SCHATS 230915	6,000,000.00	5,983,500.00	
0 SPAIN GOVT 240531	1,600,000.00	1,573,649.60	
0 SPAIN GOVT 250131	2,930,000.00	2,849,029.45	
0 SPAIN GOVT 250531	5,000,000.00	4,825,020.00	
0 SPAIN GOVT 260131	3,000,000.00	2,856,045.00	
0 SPAIN GOVT 270131	2,800,000.00	2,606,352.00	
0 SPAIN GOVT 280131	2,800,000.00	2,549,890.00	
0.1 BEL GOVT 300622	1,500,000.00	1,340,155.84	
0.1 SPAIN GOVT 310430	2,660,000.00	2,220,544.06	
0.125 FINNISH GOV 310915	270,000.00	235,987.02	
0.125 FINNISH GOV 360415	510,000.00	399,071.81	
0.125 FINNISH GOV 520415	490,000.00	283,957.45	
0.2 IRISH GOVT 301018	620,000.00	554,177.08	
0.25 AUSTRIA GOVT 361020	400,000.00	312,659.60	
0.25 BUND 270215	4,390,000.00	4,287,361.88	
0.25 BUND 280815	3,540,000.00	3,399,132.78	
0.25 BUND 290215	4,600,000.00	4,397,730.45	
0.25 FINNISH GOVT 400915	500,000.00	362,476.00	
0.25 ITALY GOVT 280315	1,700,000.00	1,485,907.10	
0.25 NETH GOVT 250715	1,930,000.00	1,900,590.64	
0.25 NETH GOVT 290715	2,300,000.00	2,141,592.10	
0.25 O.A.T 261125	4,750,000.00	4,576,772.25	
0.35 BEL GOVT 320622	750,000.00	649,701.19	
0.35 IRISH GOVT 321018	400,000.00	346,390.53	
	3,060,000.00	2,952,239.04	

0.35 ITALY GOVT 250201			
0.4 BEL GOVT 400622	800,000.00	571,941.60	
0.4 IRISH GOVT 350515	700,000.00	573,583.73	
0.45 ITALY GOVT 290215	1,700,000.00	1,458,914.50	
0.5 AUSTRIA GOVT 270420	1,400,000.00	1,359,961.40	
0.5 AUSTRIA GOVT 290220	1,310,000.00	1,237,843.89	
0.5 BEL GOVT 241022	1,740,000.00	1,736,278.14	
0.5 BUND 250215	5,060,000.00	5,055,206.91	
0.5 BUND 260215	5,820,000.00	5,786,476.80	
0.5 BUND 270815	3,820,000.00	3,756,565.08	
0.5 BUND 280215	3,230,000.00	3,160,490.40	
0.5 FINNISH GOVT 260415	1,670,000.00	1,639,176.81	
0.5 FINNISH GOVT 270915	700,000.00	676,661.30	
0.5 FINNISH GOVT 280915	580,000.00	552,114.76	
0.5 FINNISH GOVT 290915	720,000.00	675,946.08	
0.5 FINNISH GOVT 430415	330,000.00	239,528.85	
0.5 ITALY GOVT 260201	2,450,000.00	2,317,700.00	
0.5 ITALY GOVT 280715	2,000,000.00	1,758,378.00	
0.5 NETH GOVT 260715	3,850,000.00	3,786,952.40	
0.5 NETH GOVT 320715	400,000.00	362,479.60	
0.5 NETH GOVT 400115	1,840,000.00	1,488,028.24	
0.5 O.A.T 250525	5,840,000.00	5,787,235.60	
0.5 O.A.T 260525	5,300,000.00	5,196,761.30	
0.5 O.A.T 290525	5,900,000.00	5,559,275.00	
0.5 O.A.T 400525	2,630,000.00	1,962,784.46	
0.5 O.A.T 440625	1,730,000.00	1,199,879.56	
0.5 O.A.T 720525	1,100,000.00	530,800.60	
0.5 SPAIN GOVT 300430	2,230,000.00	1,993,011.21	
0.5 SPAIN GOVT 311031	3,900,000.00	3,327,448.80	
0.55 IRISH GOVT 410422	450,000.00	334,867.50	
0.6 ITALY GOVT 310801	3,100,000.00	2,476,255.20	
0.6 SPAIN GOVT 291031	2,150,000.00	1,959,052.05	
0.65 BEL GOVT 710622	740,000.00	376,446.14	
0.65 ITALY GOVT 231015	4,720,000.00	4,696,881.44	
0.7 AUSTRIA GOVT 710420	130,000.00	73,249.22	
0.7 SPAIN GOVT 320430	2,950,000.00	2,530,704.70	
0.75 AUSTRIA GOVT 261020	1,940,000.00	1,922,704.90	
0.75 AUSTRIA GOVT 280220	1,510,000.00	1,466,179.80	
0.75 AUSTRIA GOVT 510320	780,000.00	553,628.40	
0.75 FINNISH GOVT 310415	820,000.00	767,621.68	
0.75 NETH GOVT 270715	2,670,000.00	2,627,987.55	
0.75 NETH GOVT 280715	2,150,000.00	2,096,314.50	
0.75 O.A.T 280225	1,700,000.00	1,646,720.30	

0.75 O.A.T 280525	6,000,000.00	5,812,896.00	
0.75 O.A.T 281125	6,660,000.00	6,419,494.08	
0.75 O.A.T 520525	3,690,000.00	2,446,016.13	
0.75 O.A.T 530525	2,300,000.00	1,489,003.90	
0.8 BEL GOVT 250622	2,970,000.00	2,973,118.50	
0.8 BEL GOVT 270622	1,930,000.00	1,896,726.80	
0.8 BEL GOVT 280622	1,750,000.00	1,702,632.75	
0.8 SPAIN GOVT 270730	2,500,000.00	2,403,000.00	
0.85 ITALY GOVT 270115	2,310,000.00	2,164,865.01	
0.85 SPAIN GOVT 370730	250,000.00	191,998.75	
0.875 FINNISH GOV 250915	630,000.00	630,040.32	
0.9 AUSTRIA GOVT 320220	620,000.00	573,118.08	
0.9 BEL GOVT 290622	2,280,000.00	2,202,986.16	
0.9 IRISH GOVT 280515	1,360,000.00	1,326,584.80	
0.9 ITALY GOVT 310401	2,830,000.00	2,349,290.54	
0.95 ITALY GOVT 270915	1,000,000.00	925,939.00	
0.95 ITALY GOVT 300801	1,000,000.00	850,339.00	
0.95 ITALY GOVT 311201	2,050,000.00	1,678,590.75	
0.95 ITALY GOVT 320601	2,100,000.00	1,695,004.50	
0.95 ITALY GOVT 370301	2,060,000.00	1,490,863.20	
1 BEL GOVT 260622	2,240,000.00	2,240,616.00	
1 BEL GOVT 310622	1,800,000.00	1,704,902.40	
1 BUND 240815	3,600,000.00	3,637,317.60	
1 BUND 250815	4,740,000.00	4,797,638.40	
1 BUND 380515	700,000.00	658,867.74	
1 IRISH GOVT 260515	1,640,000.00	1,641,963.08	
1 O.A.T 251125	4,480,000.00	4,492,250.56	
1 O.A.T 270525	4,550,000.00	4,512,498.90	
1 SPAIN GOVT 420730	350,000.00	255,407.95	
1 SPAIN GOVT 501031	2,380,000.00	1,515,084.20	
1.1 IRISH GOVT 290515	1,400,000.00	1,372,426.30	
1.1 ITALY GOVT 270401	1,100,000.00	1,035,493.80	
1.125 FINNISH GOV 340415	860,000.00	795,373.58	
1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1,710,000.00	1,732,125.69	
1.2 SPAIN GOVT 401031	2,330,000.00	1,796,553.49	
1.25 BEL GOVT 330422	1,580,000.00	1,495,732.28	
1.25 BUND 480815	3,600,000.00	3,463,511.67	
1.25 ITALY GOVT 261201	2,680,000.00	2,565,971.36	
1.25 O.A.T 340525	4,370,000.00	4,048,778.78	
1.25 O.A.T 360525	5,000,000.00	4,515,355.00	
1.25 O.A.T 380525	400,000.00	351,288.38	
1.25 SPAIN GOVT 301031	3,230,000.00	3,027,537.14	

1.3 IRISH GOVT 330515	630,000.00	595,779.23
1.3 SPAIN GOVT 261031	2,250,000.00	2,235,901.50
1.35 IRISH GOVT 310318	1,070,000.00	1,051,197.96
1.35 ITALY GOVT 300401	3,610,000.00	3,209,678.07
1.375 FINNISH GOV 470415	540,000.00	471,701.34
1.4 BEL GOVT 530622	950,000.00	724,561.20
1.4 SPAIN GOVT 280430	2,540,000.00	2,496,726.02
1.4 SPAIN GOVT 280730	3,000,000.00	2,939,607.00
1.45 BEL GOVT 370622	720,000.00	647,763.12
1.45 ITALY GOVT 241115	2,400,000.00	2,385,986.40
1.45 ITALY GOVT 250515	2,300,000.00	2,270,573.80
1.45 ITALY GOVT 360301	1,540,000.00	1,221,605.00
1.45 SPAIN GOVT 271031	2,330,000.00	2,306,952.61
1.45 SPAIN GOVT 290430	2,560,000.00	2,494,545.92
1.45 SPAIN GOVT 711031	750,000.00	437,343.75
1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1,150,000.00	1,020,705.50
1.5 AUSTRIA GOVT 861102	460,000.00	349,634.78
1.5 BUND 240515	3,460,000.00	3,528,042.63
1.5 IRISH GOVT 500515	920,000.00	760,196.00
1.5 ITALY GOVT 250601	2,500,000.00	2,471,304.50
1.5 ITALY GOVT 450430	1,200,000.00	838,170.05
1.5 O.A.T 310525	6,400,000.00	6,366,598.40
1.5 O.A.T 500525	3,890,000.00	3,246,352.82
1.5 SPAIN GOVT 270430	3,000,000.00	2,991,644.76
1.6 BEL GOVT 470622	1,370,000.00	1,153,241.34
1.6 ITALY GOVT 260601	3,020,000.00	2,960,578.48
1.6 SPAIN GOVT 250430	510,000.00	516,194.46
1.65 AUSTRIA GOVT 241021	630,000.00	645,576.75
1.65 ITALY GOVT 301201	2,870,000.00	2,568,256.81
1.65 ITALY GOVT 320301	2,800,000.00	2,447,096.40
1.7 BEL GOVT 500622	1,160,000.00	980,433.16
1.7 IRISH GOVT 370515	1,180,000.00	1,125,426.18
1.7 ITALY GOVT 510901	2,060,000.00	1,409,396.38
1.75 AUSTRIA GOVT 231020	4,000,000.00	4,070,540.00
1.75 BUND 240215	5,000,000.00	5,111,675.00
1.75 O.A.T 241125	4,020,000.00	4,118,075.94
1.75 O.A.T 390625	3,750,000.00	3,562,395.00
1.75 O.A.T 660525	1,750,000.00	1,464,636.25
1.8 ITALY GOVT 410301	1,990,000.00	1,541,135.60
1.85 AUSTRIA GOVT 490523	490,000.00	462,977.48
1.85 ITALY GOVT 240515	2,370,000.00	2,386,061.49
1.85 ITALY GOVT 250701	800,000.00	796,708.00
1.85 SPAIN GOVT 350730	2,500,000.00	2,300,090.00

1.9 BEL GOVT 380622	1,110,000.00	1,057,754.52	
1.9 SPAIN GOVT 521031	800,000.00	622,783.20	
1.95 SPAIN GOVT 260430	3,370,000.00	3,437,598.83	
1.95 SPAIN GOVT 300730	2,590,000.00	2,574,390.07	
2 BUND 230815	3,500,000.00	3,564,697.50	
2 FINNISH GOVT 240415	1,620,000.00	1,663,744.86	
2 IRISH GOVT 450218	1,220,000.00	1,164,444.86	
2 ITALY GOVT 251201	2,680,000.00	2,676,700.92	
2 ITALY GOVT 280201	3,580,000.00	3,475,682.38	
2 NETH GOVT 240715	2,100,000.00	2,159,929.80	
2 O.A.T 480525	3,430,000.00	3,223,836.42	
2.05 ITALY GOVT 270801	3,050,000.00	2,989,736.39	
2.1 AUSTRIA GOVT 170920	1,040,000.00	953,452.36	
2.1 ITALY GOVT 260715	2,350,000.00	2,341,070.00	
2.15 BEL GOVT 660622	810,000.00	744,105.69	
2.15 ITALY GOVT 520901	200,000.00	149,005.00	
2.15 SPAIN GOVT 251031	3,180,000.00	3,273,778.20	
2.2 ITALY GOVT 270601	2,500,000.00	2,474,112.50	
2.25 BEL GOVT 570622	780,000.00	740,800.32	
2.25 ITALY GOVT 360901	1,840,000.00	1,608,842.64	
2.25 O.A.T 240525	6,190,000.00	6,381,970.47	
2.35 SPAIN GOVT 330730	2,610,000.00	2,595,146.49	
2.4 AUSTRIA GOVT 340523	1,160,000.00	1,227,510.84	
2.4 IRISH GOVT 300515	1,640,000.00	1,753,925.88	
2.45 ITALY GOVT 231001	5,850,000.00	5,945,333.94	
2.45 ITALY GOVT 330901	2,470,000.00	2,270,671.00	
2.45 ITALY GOVT 500901	1,990,000.00	1,614,745.70	
2.5 BUND 440704	3,500,000.00	4,218,984.00	
2.5 BUND 460815	3,790,000.00	4,631,001.00	
2.5 ITALY GOVT 241201	2,830,000.00	2,879,652.35	
2.5 ITALY GOVT 251115	2,330,000.00	2,362,251.86	
2.5 ITALY GOVT 321201	600,000.00	555,739.80	
2.5 NETH GOVT 330115	2,010,000.00	2,194,984.52	
2.5 O.A.T 300525	6,850,000.00	7,385,950.85	
2.55 SPAIN GOVT 321031	750,000.00	757,523.25	
2.6 BEL GOVT 240622	2,980,000.00	3,094,941.58	
2.625 FINNISH GOV 420704	680,000.00	734,632.56	
2.7 ITALY GOVT 470301	2,260,000.00	1,985,911.72	
2.7 SPAIN GOVT 481031	1,920,000.00	1,862,152.32	
2.75 FINNISH GOVT 280704	730,000.00	792,595.31	
2.75 NETH GOVT 470115	2,390,000.00	2,872,579.24	
2.75 O.A.T 271025	6,690,000.00	7,210,816.50	

2.8 ITALY GOVT 281201	2,880,000.00	2,894,339.52
2.8 ITALY GOVT 290615	700,000.00	695,295.30
2.8 ITALY GOVT 670301	2,460,000.00	2,009,542.02
2.9 SPAIN GOVT 461031	2,310,000.00	2,334,717.00
2.95 ITALY GOVT 380901	1,780,000.00	1,679,584.86
3 BEL GOVT 340622	930,000.00	1,026,126.66
3 ITALY GOVT 290801	2,800,000.00	2,826,745.60
3.1 ITALY GOVT 400301	1,640,000.00	1,564,966.72
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	840,000.00	999,221.83
3.25 BUND 420704	2,230,000.00	2,944,286.84
3.25 ITALY GOVT 380301	420,000.00	409,216.50
3.25 ITALY GOVT 460901	2,100,000.00	2,038,270.50
3.25 O.A.T 450525	3,690,000.00	4,324,569.30
3.35 ITALY GOVT 350301	1,830,000.00	1,825,333.50
3.4 IRISH GOVT 240318	820,000.00	858,884.40
3.45 ITALY GOVT 480301	2,070,000.00	2,055,928.14
3.45 SPAIN GOVT 660730	1,800,000.00	1,930,761.00
3.5 ITALY GOVT 300301	3,750,000.00	3,907,995.00
3.5 O.A.T 260425	5,590,000.00	6,106,946.43
3.75 BEL GOVT 450622	1,320,000.00	1,622,914.92
3.75 ITALY GOVT 240901	3,230,000.00	3,374,918.14
3.75 NETH GOVT 420115	2,210,000.00	2,931,965.01
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	560,000.00	787,208.12
3.8 SPAIN GOVT 240430	6,210,000.00	6,529,683.34
3.85 ITALY GOVT 490901	1,640,000.00	1,733,073.28
4 BEL GOVT 320328	1,140,000.00	1,374,683.82
4 BUND 370104	3,480,000.00	4,666,961.88
4 FINNISH GOVT 250704	640,000.00	700,416.00
4 ITALY GOVT 370201	3,460,000.00	3,710,175.30
4 NETH GOVT 370115	2,400,000.00	3,093,517.44
4 O.A.T 381025	3,190,000.00	3,999,019.09
4 O.A.T 550425	2,500,000.00	3,387,797.50
4 O.A.T 600425	1,950,000.00	2,694,907.80
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	1,870,000.00	2,364,606.95
4.2 SPAIN GOVT 370131	2,950,000.00	3,518,108.05
4.25 BEL GOVT 410328	2,200,000.00	2,802,236.58
4.25 BUND 390704	2,150,000.00	3,065,592.55
4.25 O.A.T 231025	5,500,000.00	5,770,237.00
4.4 SPAIN GOVT 231031	7,300,000.00	7,634,164.80
4.5 BEL GOVT 260328	1,290,000.00	1,456,544.16
4.5 ITALY GOVT 240301	5,920,000.00	6,224,891.84
4.5 ITALY GOVT 260301	3,440,000.00	3,735,310.24
4.5 O.A.T 410425	4,640,000.00	6,209,025.28

	4.65 SPAIN GOVT 250730	2,310,000.00	2,547,800.64	
	4.7 SPAIN GOVT 410730	2,620,000.00	3,387,128.14	
	4.75 BUND 280704	1,790,000.00	2,188,547.43	
	4.75 BUND 340704	3,050,000.00	4,237,877.40	
	4.75 BUND 400704	2,450,000.00	3,731,124.60	
	4.75 ITALY GOVT 280901	3,090,000.00	3,440,248.41	
	4.75 ITALY GOVT 440901	2,220,000.00	2,654,271.96	
	4.75 O.A.T 350425	3,540,000.00	4,648,041.24	
	4.85 AUSTRIA GOVT 260315	1,370,000.00	1,566,630.62	
	4.9 SPAIN GOVT 400730	2,810,000.00	3,690,738.30	
	5 BEL GOVT 350328	2,540,000.00	3,371,659.50	
	5 ITALY GOVT 250301	3,100,000.00	3,355,136.20	
	5 ITALY GOVT 340801	3,000,000.00	3,496,650.00	
	5 ITALY GOVT 390801	2,700,000.00	3,246,096.60	
	5 ITALY GOVT 400901	2,690,000.00	3,249,721.75	
	5.15 SPAIN GOVT 281031	2,500,000.00	2,995,910.00	
	5.15 SPAIN GOVT 441031	2,230,000.00	3,102,824.23	
	5.25 ITALY GOVT 291101	3,610,000.00	4,192,654.00	
	5.4 IRISH GOVT 250313	1,100,000.00	1,232,867.90	
	5.5 BEL GOVT 280328	2,760,000.00	3,416,190.00	
	5.5 BUND 310104	4,400,000.00	5,982,994.60	
	5.5 NETH GOVT 280115	1,480,000.00	1,822,717.68	
	5.5 O.A.T 290425	4,860,000.00	6,151,190.22	
	5.625 BUND 280104	1,790,000.00	2,244,246.33	
	5.75 ITALY GOVT 330201	2,660,000.00	3,246,303.90	
	5.75 O.A.T 321025	4,460,000.00	6,137,722.66	
	5.75 SPAIN GOVT 320730	2,490,000.00	3,265,415.88	
	5.9 SPAIN GOVT 260730	1,000,000.00	1,176,453.00	
	6 ITALY GOVT 310501	3,440,000.00	4,223,171.04	
	6 O.A.T 251025	3,490,000.00	4,062,604.30	
	6 SPAIN GOVT 290131	3,100,000.00	3,907,261.39	
	6.25 AUSTRIA GOVT 270715	1,240,000.00	1,555,475.84	
	6.25 BUND 300104	3,150,000.00	4,341,180.37	
	6.5 BUND 270704	2,250,000.00	2,867,231.25	
	6.5 ITALY GOVT 271101	3,950,000.00	4,759,285.87	
	7.25 ITALY GOVT 261101	1,600,000.00	1,934,640.00	
	9 ITALY GOVT 231101	3,350,000.00	3,684,041.90	
ユーロ合計		781,060,000.00	786,405,178.27 (110,175,365,475)	
合計			318,662,052,622 (318,662,052,622)	

(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 227銘柄	100.00%	51.35%
カナダドル	国債証券 29銘柄	100.00%	2.02%
オーストラリアドル	国債証券 25銘柄	100.00%	1.52%
イギリスポンド	国債証券 53銘柄	100.00%	4.94%
シンガポールドル	国債証券 17銘柄	100.00%	0.42%
マレーシアリンギット	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%	0.26%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.00%	0.20%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.00%	0.37%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.00%	0.77%
イスラエルシェケル	国債証券 8銘柄	100.00%	0.40%
ポーランドズロチ	国債証券 12銘柄	100.00%	0.40%
中国元	国債証券 41銘柄	100.00%	2.27%
ユーロ	国債証券 320銘柄	100.00%	34.57%

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】

【三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）】

【純資産額計算書】

令和 4年 7月29日現在

（単位：円）

I 資産総額	1,034,376,703
II 負債総額	1,445,162
III 純資産総額（I－II）	1,032,931,541
IV 発行済口数	1,128,262,354口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	0.9155

(10,000口当たり)	(9,155)
--------------	---------

(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 7月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	324,408,153,700
II 負債総額	1,629,832,448
III 純資産総額（I－II）	322,778,321,252
IV 発行済口数	135,296,241,466口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	2.3857
(10,000口当たり)	(23,857)

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

＜更新後＞

（１）資本金の額等

2022年7月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、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ファンドに係る法人等の管理

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

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】

<更新後>

「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 7月29日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本 数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	899	20,193,882
追加型公社債投資信託	16	1,402,272
単位型株式投資信託	95	483,049
単位型公社債投資信託	52	161,964
合 計	1,062	22,241,167

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】

<更新後>

（1）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。

なお、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37期事業年度（自 令和3年4月1日 至 令和4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。

（1）【貸借対照表】

(単位：千円)

第36期 (令和3年3月31日現在)	第37期 (令和4年3月31日現在)
-----------------------	-----------------------

(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	※2	56,803,388	※2	51,593,362
有価証券		2,001		293,326
前払費用		598,135		645,109
未収入金		31,359		61,092
未収委託者報酬		13,216,357		15,750,264
未収収益	※2	662,230	※2	783,790
金銭の信託		2,300,000		8,401,300
その他		269,506		295,584
流動資産合計		73,882,978		77,823,830
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	548,902	※1	391,042
器具備品	※1	1,435,369	※1	1,079,023
土地		628,433		628,433
有形固定資産合計		2,612,705		2,098,499
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		3,569,171		4,381,293
ソフトウェア仮勘定		1,895,190		1,581,652
無形固定資産合計		5,480,184		5,978,768
投資その他の資産				
投資有価証券		18,616,670		16,803,642
関係会社株式		320,136		159,536
投資不動産	※1	814,684	※1	810,684
長期差入保証金		538,497		524,244
前払年金費用		258,835		189,708
繰延税金資産		916,962		982,406
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		21,487,417		19,491,852
固定資産合計		29,580,307		27,569,120
資産合計		103,463,286		105,392,950

(単位：千円)

第36期 (令和3年3月31日現在)		第37期 (令和4年3月31日現在)	
(負債の部)			
流動負債			
預り金	533,622		565,222
未払金			
未払収益分配金	158,856		197,334
未払償還金	133,877		7,418
未払手数料	※2 5,200,810	※2	6,423,139
その他未払金	※2 4,412,521	※2	4,565,457

未払費用	※2	4,755,909	※2	4,328,968
未払消費税等		752,617		1,112,923
未払法人税等		873,027		769,692
賞与引当金		933,381		942,287
役員賞与引当金		160,710		149,028
その他		691,143		5,517
流動負債合計		18,606,476		19,066,990
固定負債				
長期未払金		21,600		10,800
退職給付引当金		1,145,514		1,246,300
役員退職慰労引当金		117,938		117,938
時効後支払損引当金		245,426		250,214
固定負債合計		1,530,479		1,625,252
負債合計		20,136,956		20,692,243
(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		26,951,289		29,000,498
利益剰余金合計		34,291,879		36,341,088
株主資本合計		81,024,723		83,073,932

(単位：千円)

	第36期 (令和3年3月31日現在)	第37期 (令和4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	2,301,606	1,626,775
評価・換算差額等合計	2,301,606	1,626,775
純資産合計	83,326,329	84,700,707
負債純資産合計	103,463,286	105,392,950

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)	第37期 (自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日)
--	-------------------------------------	-------------------------------------

営業収益				
委託者報酬		67,963,712		79,977,953
投資顧問料		2,443,980		2,711,169
その他営業収益		21,613		13,459
営業収益合計		70,429,306		82,702,582
営業費用				
支払手数料	※2	26,689,896	※2	31,644,834
広告宣伝費		668,150		720,785
公告費		250		500
調査費				
調査費		2,077,942		2,430,158
委託調査費		12,035,954		14,557,009
事務委託費		798,528		1,450,062
営業雑経費				
通信費		296,490		138,868
印刷費		378,180		379,428
協会費		51,841		49,590
諸会費		16,613		17,729
事務機器関連費		1,977,769		2,172,978
その他営業雑経費		8,391		649
営業費用合計		45,000,009		53,562,596
一般管理費				
給料				
役員報酬		352,879		414,260
給料・手当		6,461,546		6,496,233
賞与引当金繰入		933,381		942,287
役員賞与引当金繰入		160,710		149,028
福利厚生費		1,272,568		1,282,310
交際費		2,721		4,874
旅費交通費		22,768		21,698
租税公課		402,939		430,233
不動産賃借料		666,331		724,961
退職給付費用		481,135		494,615
役員退職慰労引当金繰入		11,763		-
固定資産減価償却費		1,358,911		2,249,287
諸経費		413,538		379,054
一般管理費合計		12,541,193		13,588,846
営業利益		12,888,103		15,551,139

(単位：千円)

		第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)		第37期 (自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日)
営業外収益				
受取配当金		170,807		243,133
受取利息	※2	2,726	※2	7,408
投資有価証券償還益		81,557		1,089,101
収益分配金等時効完成分		275,835		137,485
受取賃貸料	※2	65,808	※2	65,808

その他	12,504	36,211
営業外収益合計	609,239	1,579,148
営業外費用		
投資有価証券償還損	95,946	3,074
時効後支払損引当金繰入	16,395	16,548
事務過誤費	-	76,076
賃貸関連費用	13,472	15,780
その他	2,932	7,585
営業外費用合計	128,747	119,066
経常利益	13,368,595	17,011,221
特別利益		
投資有価証券売却益	2,007,655	605,706
特別利益合計	2,007,655	605,706
特別損失		
投資有価証券売却損	51,737	28,188
投資有価証券評価損	26,317	36,558
固定資産除却損	※1 536	※1 13,094
特別損失合計	78,591	77,840
税引前当期純利益	15,297,659	17,539,087
法人税、住民税及び事業税	※2 4,755,427	※2 5,366,608
法人税等調整額	△19,122	22,446
法人税等合計	4,736,304	5,389,054
当期純利益	10,561,354	12,150,032

(3) 【株主資本等変動計算書】

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			利益準備金	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		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

第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4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	26,951,289	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
当期変動額									
剰余金の配当							△10,576,511	△10,576,511	△10,576,511
当期純利益							12,150,032	12,150,032	12,150,032
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	—	—	—	—	—	—	1,573,521	1,573,521	1,573,521
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	29,000,498	36,341,088	83,073,932

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

[注記事項]

（重要な会計方針）

1.有価証券の評価基準及び評価方法

(1)子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2)その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2.金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3.固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産及び投資不動産

定率法を採用しております。ただし、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.収益及び費用の計上基準

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

(1)委託者報酬

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

(2)投資顧問料

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

7.その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(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、「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」（実務対応報告第39号 令和2年3月31日）により「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日）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。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取り扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 令和3年8月12日）を適用する予定であります。

（会計方針の変更）

（1）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。）等を当事業年度の期首から適用し、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、当事業年度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、当事業年度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、当事業年度の貸借対照表は、流動負債のその他は484,886千円減少、繰延税金資産は148,472千円減少、繰越利益剰余金は336,414千円増加しております。

当事業年度の損益計算書は、委託者報酬、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ200,739千円減少しております。

当事業年度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、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。

（2）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。）等を当事業年度の期首から適用し、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、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。

（未適用の会計基準等）

「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3年6月17日）

（1）概要

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 企業会計基準適用指針第31号）の令和3年6月17日の改正は、令和元年7月4日の公表時において、「投資信託の時価の算定」に関する検討には、関係者との協議等に一定の期間が必要と考えられるため、また、「貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資」の時価の注記についても、一定の検討を要するため、「時価の算定に関する会計基準」公表後、概ね1年をかけて検討を行うこととされていたものが、改正され、公表されたものです。

（2）適用予定日

令和5年3月期の期首より適用します。

（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の適用指針」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36期 (令和3年3月31日現在)	第37期 (令和4年3月31日現在)
建物	643,920千円	805,250千円
器具備品	1,545,179千円	2,054,366千円

投資不動産

151,833千円

157,995千円

※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36期 (令和3年3月31日現在)	第37期 (令和4年3月31日現在)
預金	40,328,414千円	43,782,913千円
未収収益	14,138千円	13,741千円
未払手数料	772,495千円	836,105千円
その他未払金	3,425,136千円	3,887,520千円
未払費用	349,222千円	337,847千円

(損益計算書関係)

※1.固定資産除却損の内訳

	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)	第37期 (自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日)
建物	-	2,599千円
器具備品	536千円	10,495千円
計	536千円	13,094千円

※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36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)	第37期 (自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日)
支払手数料	5,128,270千円	5,153,589千円
受取利息	143千円	7,377千円
受取賃貸料	65,808千円	65,808千円
法人税、住民税及び事業税	3,492,898千円	4,062,765千円

(株主資本等変動計算書関係)

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

第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4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 1株当たり配当額	49,988円
③ 基準日	令和3年3月31日
④ 効力発生日	令和3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4年6月28日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

① 配当金の総額	6,075,125千円
② 配当の原資	利益剰余金
③ 1株当たり配当額	28,713円
④ 基準日	令和4年3月31日
⑤ 効力発生日	令和4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36期 (令和3年3月31日現在)	第37期 (令和4年3月31日現在)
1年内	709,808千円	709,808千円
1年超	709,808千円	414,054千円
合計	1,419,616千円	1,123,863千円

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、金銭の信託（合同運用指定金銭信託）で運用し、金融機関からの資金調達は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

第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) 有価証券	2,001	2,001	—
(2) 金銭の信託	2,300,000	2,300,000	—

(3) 投資有価証券	18,585,310	18,585,310	—
資産計	20,887,311	20,887,311	—

(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) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（前事業年度の貸借対照表計上額31,360千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(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（前事業年度の貸借対照表計上額 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。

(注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。

(注4) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第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

第37期(令和4年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 有価証券	293,326	293,326	—
(2) 金銭の信託	8,401,300	8,401,300	—
(3) 投資有価証券	16,772,282	16,772,282	—
資産計	25,466,909	25,466,909	—

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

(注2) 市場価格のない株式等

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

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

(注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。

(注4) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第37期(令和4年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	51,593,362	—	—	—
金銭の信託	8,401,300	—	—	—
未収委託者報酬	15,750,264	—	—	—
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	293,326	6,911,464	3,695,585	—
合計	76,038,253	6,911,464	3,695,585	—

3.金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

なお、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（貸借対照表計上額 有価証券 293,326千円、投資有価証券16,772,282千円）は、次表には含めておりません。

時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

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

（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）

1.子会社株式及び関連会社株式

前事業年度の子会社株式及び関連会社株式（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、記載していません。

また、当事業年度の関連会社株式（貸借対照表計上額は関連会社株式159,536千円）は、市場価格がないため、記載していません。

2.その他有価証券

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、取得原価は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。

第37期(令和4年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	19,193,250	16,560,340	2,632,910
	小計	19,193,250	16,560,340	2,632,910
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	6,273,658	6,561,836	△288,177
	小計	6,273,658	6,561,836	△288,177
合計		25,466,909	23,122,176	2,344,732

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

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

3. 売却したその他有価証券

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

第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日）

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	—	—	—
債券	—	—	—
その他	4,164,921	605,706	28,188
合計	4,164,921	605,706	28,188

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。

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

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36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)	第37期 (自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,718,736 千円	3,729,235 千円
勤務費用	203,106	198,457
利息費用	19,110	21,549
数理計算上の差異の発生額	△18,826	△46,069

退職給付の支払額	△192,890	△179,650
過去勤務費用の発生額	—	—
退職給付債務の期末残高	3,729,235	3,723,521

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)	第37期 (自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日)
年金資産の期首残高	2,460,824 千円	2,649,846 千円
期待運用収益	44,130	47,588
数理計算上の差異の発生額	304,281	1,824
事業主からの拠出額	—	—
退職給付の支払額	△159,390	△115,331
年金資産の期末残高	2,649,846	2,583,927

(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36期 (令和3年3月31日現在)	第37期 (令和4年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	2,810,893 千円	2,675,015 千円
年金資産	△2,649,846	△2,583,927
	161,046	91,087
非積立型制度の退職給付債務	918,342	1,048,506
未積立退職給付債務	1,079,388	1,139,593
未認識数理計算上の差異	161,333	205,679
未認識過去勤務費用	△354,043	△288,681
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	886,678	1,056,591
退職給付引当金	1,145,514	1,246,300
前払年金費用	△258,835	△189,708
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	886,678	1,056,591

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)	第37期 (自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日)
勤務費用	203,106 千円	198,457 千円
利息費用	19,110	21,549
期待運用収益	△44,130	△47,588
数理計算上の差異の費用処理額	41,361	△3,547
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	44,446	109,013
確定給付制度に係る退職給付費用	329,255	343,245

(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36期 (令和3年3月31日現在)	第37期 (令和4年3月31日現在)
債券	62.7 %	62.0 %
株式	35.4	36.3
その他	1.9	1.7
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36期 (令和3年3月31日現在)	第37期 (令和4年3月31日現在)
割引率	0.051～0.59%	0.078～0.72%
長期期待運用収益率	1.5～1.8%	1.5～1.8%

3.確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度151,880千円、当事業年度151,370千円であります。

(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36期 (令和3年3月31日現在)	第37期 (令和4年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	418,394千円	410,082千円
投資有価証券評価損	188,859	65,490
未払事業税	180,263	165,702
賞与引当金	285,801	288,528
役員賞与引当金	25,472	25,799
役員退職慰労引当金	36,112	36,112
退職給付引当金	350,756	381,617
減価償却超過額	68,024	145,316
委託者報酬	209,938	-
長期差入保証金	48,639	52,869
時効後支払損引当金	75,149	76,615
連結納税適用による時価評価	38,873	35,311
その他	87,023	76,257
繰延税金資産 小計	2,013,308	1,759,702
評価性引当額	—	—
繰延税金資産 合計	2,013,308	1,759,702
繰延税金負債		
前払年金費用	△79,225	△58,088
連結納税適用による時価評価	△1,203	△1,149
その他有価証券評価差額金	△1,015,785	△717,957
その他	△101	△101
繰延税金負債 合計	△1,096,346	△777,296
繰延税金資産の純額	916,962	982,406

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36期（令和3年3月31日現在）及び第37期（令和4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。

（収益認識関係）

1.顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

2.顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）及び第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4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36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）及び第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4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

第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4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)	4,062,765 千円	その他未払金	3,887,520 千円
親会社	三菱UFJ 信託銀行㈱	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,153,589 千円	未払手数料	836,105 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 (注3)	499,388 千円	未払費用	272,264 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2)	科目	期末残高 (注2)
同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ 銀行	東京都 千代田 区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料 の支払 (注1)	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(株)	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
-------------	----------------------------------	-----------------	---------------	-----	----	---	---------------------------------------	-----------------	-------	-----------------

第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日）

種類	会社等の 名称	所在地	資本金	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (注2)	科目	期末残高 (注2)
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ 銀行	東京都 千代田 区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料 の支払 (注1)	4,097,951 千円	未払手数料	838,058 千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・ スタンレー 証券(株)	東京都 千代田 区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料 の支払 (注1)	7,025,984 千円	未払手数料	1,319,958 千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 1. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

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

2.親会社に関する注記

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

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)	第37期 (自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日)
1株当たり純資産額	393,827.09円	400,322.84円
1株当たり当期純利益金額	49,916.36円	57,424.97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、記載していません。

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、当事業年度の1株当たり純資産額は2,248.25円増加し、1株当たり純利益金額は658.24円減少しております。

3. 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36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)	第37期 (自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日)
当期純利益金額 (千円)	10,561,354	12,150,032
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)	10,561,354	12,150,032
普通株式の期中平均株式数 (株)	211,581	211,581

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】

<更新後>

(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（2022年3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 (2022年3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。
auカブコム証券株式会社	7,196 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	17,495 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
フィデリティ証券株式会社	11,757 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

3【資本関係】

<訂正前>

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1月末現在）
三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の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。

<訂正後>

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7月末現在）
三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の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【その他】

<訂正前>

- (1) 目論見書の表紙にロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、また使用開始日、ファンドの形態、申込みに係る事項、ファンド専用サイトのアドレスなどを記載することがあります。
- (2) 投資信託説明書（交付目論見書）に、以下の趣旨の文言の全部または一部および有価証券届出書の主要内容を記載することがあります。
 - ・ファンドに関する投資信託説明書（請求目論見書）を含む詳細な情報は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
 - ・本書には、約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されています。
 - ・ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
 - ・ファンドの商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認します。
 - ・ファンドの財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
 - ・請求目論見書は、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。（請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようお願いいたします。）
 - ・有価証券届出書の効力の発生の有無については、委託会社のホームページにて確認いただけます。効力が発生するまでに、本書の記載内容が訂正される場合があります。
- (3) 投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。
- (4) 目論見書は電磁的方法により提供されるほか、インターネット、電子媒体等に掲載されることがあります。
- (5) 投信評価機関、投信評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。
- (6) 目論見書は「投資信託説明書」を別称として使用します。
- (7) 目論見書に委託会社のホームページアドレス等を掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨のご案内を記載することがあります。

<訂正後>

- (1) 目論見書の表紙にロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、また使用開始日、ファンドの形態、申込みに係る事項、ファンド専用サイトのアドレス、ファンドの管理番号などを記載することがあります。
- (2) 投資信託説明書（交付目論見書）に、以下の趣旨の文言の全部または一部および有価証券届出書の主要内容を記載することがあります。
 - ・ファンドに関する投資信託説明書（請求目論見書）を含む詳細な情報は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
 - ・本書には、約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されています。
 - ・ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
 - ・ファンドの商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認します。
 - ・ファンドの財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
 - ・請求目論見書は、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。（請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようお願いいたします。）

- ・有価証券届出書の効力の発生の有無については、委託会社のホームページにて確認いただけます。効力が発生するまでに、本書の記載内容が訂正される場合があります。

- （３）投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。
- （４）目論見書は電磁的方法により提供されるほか、インターネット、電子媒体等に掲載されることがあります。
- （５）投信評価機関、投信評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。
- （６）目論見書は「投資信託説明書」を別称として使用します。
- （７）目論見書に委託会社のホームページアドレス等を掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨のご案内を記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

令和4年9月21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 西郷 篤
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ世界国債インデックスファンド（毎月分配型）の令和4年1月18日から令和4年7月19日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ世界国債インデックスファンド（毎月分配型）の令和4年7月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、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。

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

三菱ＵＦＪ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) １. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
２. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

令和4年6月10日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	青木裕晃
--------------------	-------	------

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱ＵＦＪ国際投信株式会社の令和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4年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

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

利害関係

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

以 上

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