【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】	2024年6月14日提出
【発行者名】	三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 横川　直
【本店の所在の場所】	東京都港区東新橋一丁目９番１号
【事務連絡者氏名】	伊藤　晃
【電話番号】	03-4223-3037
【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】	ワールド・インカムオープン
【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】

2023年12月14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、申込受付時間変更の予定記載および新しいＮＩＳＡ制度の記載等を行うため、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】

（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（2023年10月1日現在）

・金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者　関東財務局長（金商）第404号

・設立年月日
1985年8月1日

・資本金
2,000百万円

・沿革

1997年5月	東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
2004年10月	東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
2005年10月	三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ投信株式会社に変更
2015年7月	三菱ＵＦＪ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社に変更
2023年10月	エム・ユー投資顧問株式会社の有価証券運用事業を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社へ統合し、商号を三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社に変更

・大株主の状況

株　主　名	住　　所	所有株式数	所有比率
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に関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。

③委託会社の概況（2024年４月１日現在）

・金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者　関東財務局長（金商）第404号

・設立年月日
1985年8月1日

・資本金
2,000百万円

・沿革

1997年5月	東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
2004年10月	東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
2005年10月	三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ投信株式会社に変更
2015年7月	三菱ＵＦＪ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社に変更
2023年10月	エム・ユー投資顧問株式会社の有価証券運用事業を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社へ統合し、商号を三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社に変更

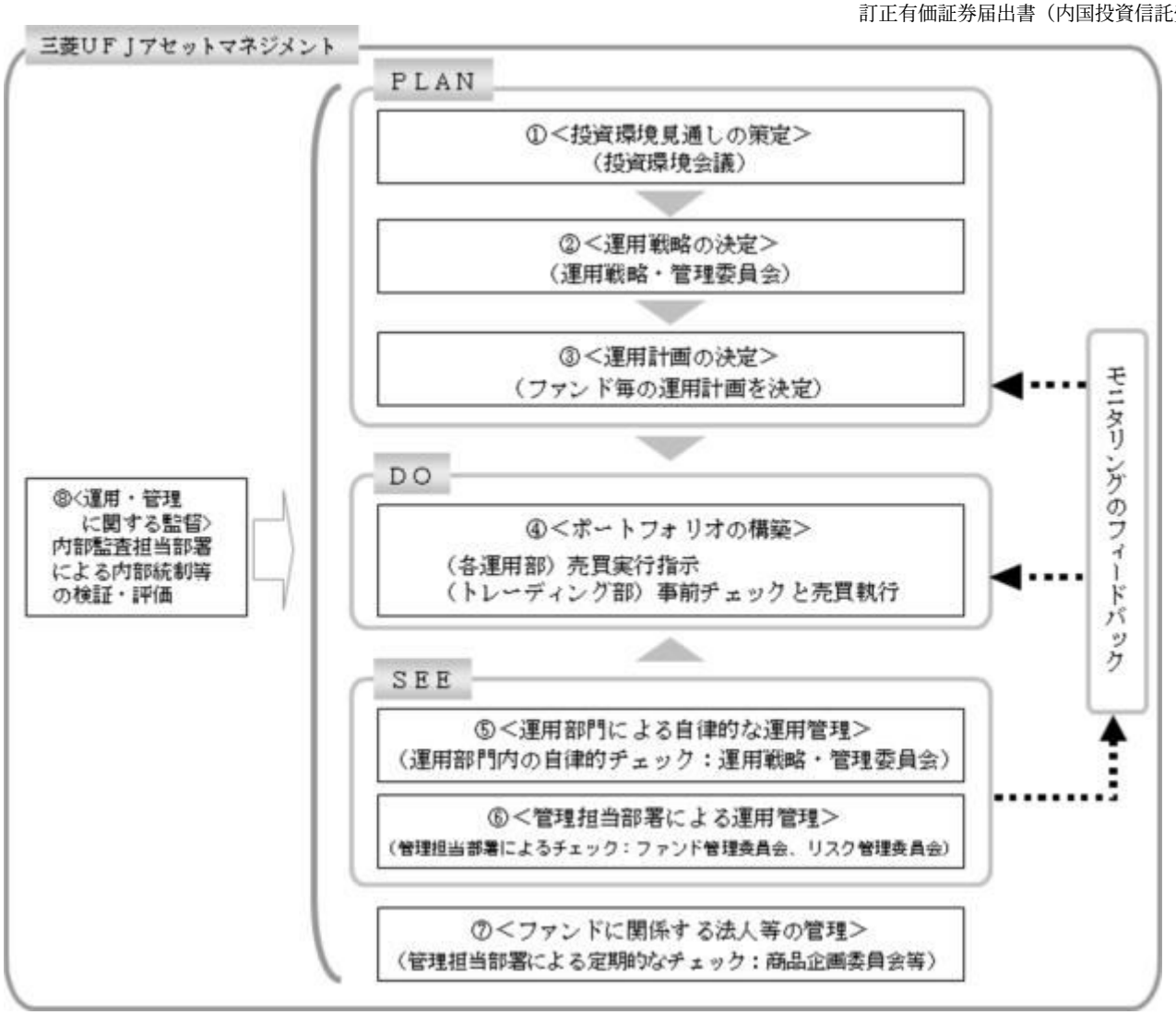
・大株主の状況

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

２【投資方針】

（３）【運用体制】

＜更新後＞



①投資環境見通しの策定
投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

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

③運用計画の決定
②で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

④ポートフォリオの構築
各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

⑤運用部門による自律的な運用管理
運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、運用部門内の管理担当部署は逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また、運用戦略・管理委員会を通じて運用状況のモニタリングを行い、運用部門内での自律的牽制により運用改善を図ります。

⑥管理担当部署による運用管理
運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、（a）運用に関するパフォーマンス測定・分析のほか、（b）リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、（a）についてはファンド管理委員会を経て運用担当部・商品開発担当部にフィードバックされ、（b）についてはリスク管理委員会を通じて運用担当部にフィードバックされ、必要に応じて部署間連携の上で是正・改善の検討が行われます。

⑦ファンドに関係する法人等の管理
受託会社等、ファンドの運営に関係する法人については、その業務に関する委託会社の管理担

当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、商品企画委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

⑧運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（10名程度）は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。
なお、委託会社に関する「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページでご覧いただけます。
「運用担当者に係る事項」　https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html

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。

・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。
投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。
収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。

・当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。

・当ファンドは、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きを概ね捉えることをめざして運用を行いますが、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、債券先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響、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カイ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、ファンド管理委員会およびリスク管理委員会においてそれらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を検討しています。
また、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策を策定し流動性リスクの評価と管理プロセスの検証などを行います。リスク管理委員会は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。
具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

①コンプライアンス担当部署
法令上の禁止行為、約款の投資制限等のモニタリングを通じ、法令等遵守のための管理態勢の状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

②リスク管理担当部署
運用リスク全般の状況をモニタリング・管理するとともに、運用実績の分析および評価を行い、必要に応じて改善策等を提言します。また、事務・情報資産・その他のリスクの統括的管理を行っています。

③内部監査担当部署
委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

＊組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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

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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

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

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4【手数料等及び税金】

（5）【課税上の取扱い】

＜更新後＞

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、一定の要件を満たした場合に「ＮＩＳＡ（少額投資非課税制度）」の適用対象となります。ファンドは、ＮＩＳＡの対象ではありません。

②法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

◇個別元本について

①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

③受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

◇収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、①当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

※上記は2024年3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。

（参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間（以下「当期間」といいます。）（2023年9月16日～2024年3月15日）における当ファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率（①+②）	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
0.83%	0.82%	0.01%

（比率は年率、表示桁数未満四捨五入）

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

詳細につきましては、当期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

5【運用状況】

【ワールド・インカムオープン】

（1）【投資状況】

2024年 3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	2,578,148,246	99.99
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	258,871	0.01
純資産総額		2,578,407,117	100.00

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

（2）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

ａ評価額上位３０銘柄

2024年 3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	974,172,774	2.5917	2,524,763,579	2.6465	2,578,148,246	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

2024年 3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2024年3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44計算期間末日　(2014年 6月16日)	7,917,581,717	7,979,087,629	9,011	9,081
第45計算期間末日　(2014年 9月16日)	7,727,471,469	7,785,739,774	9,283	9,353
第46計算期間末日　(2014年12月15日)	7,926,936,054	7,989,008,083	10,216	10,296
第47計算期間末日　(2015年 3月16日)	7,253,217,921	7,305,286,299	9,751	9,821
第48計算期間末日　(2015年 6月15日)	6,970,323,494	7,019,783,995	9,865	9,935
第49計算期間末日　(2015年 9月15日)	6,590,988,470	6,638,685,931	9,673	9,743
第50計算期間末日　(2015年12月15日)	6,209,826,215	6,255,424,588	9,533	9,603
第51計算期間末日　(2016年 3月15日)	5,726,222,056	5,767,319,615	9,057	9,122
第52計算期間末日　(2016年 6月15日)	5,258,564,844	5,295,404,374	8,565	8,625
第53計算期間末日　(2016年 9月15日)	4,947,490,448	4,980,481,644	8,248	8,303
第54計算期間末日　(2016年12月15日)	5,062,808,638	5,094,622,262	8,753	8,808
第55計算期間末日　(2017年 3月15日)	4,652,072,401	4,685,147,590	8,439	8,499
第56計算期間末日　(2017年 6月15日)	4,498,023,689	4,529,936,541	8,457	8,517
第57計算期間末日　(2017年 9月15日)	4,458,995,264	4,489,899,204	8,657	8,717
第58計算期間末日　(2017年12月15日)	4,275,692,586	4,305,055,557	8,737	8,797
第59計算期間末日　(2018年 3月15日)	3,928,798,336	3,957,279,826	8,277	8,337
第60計算期間末日　(2018年 6月15日)	3,812,220,197	3,840,015,315	8,229	8,289
第61計算期間末日　(2018年 9月18日)	3,733,645,861	3,760,756,302	8,263	8,323
第62計算期間末日　(2018年12月17日)	3,535,346,415	3,558,920,961	8,248	8,303
第63計算期間末日　(2019年 3月15日)	3,429,865,509	3,452,757,759	8,240	8,295
第64計算期間末日　(2019年 6月17日)	3,284,672,281	3,306,832,994	8,152	8,207
第65計算期間末日　(2019年 9月17日)	3,259,069,560	3,276,942,977	8,205	8,250
第66計算期間末日　(2019年12月16日)	3,235,909,858	3,249,561,257	8,296	8,331
第67計算期間末日　(2020年 3月16日)	3,071,402,376	3,082,596,922	8,231	8,261
第68計算期間末日　(2020年 6月15日)	3,085,403,516	3,094,591,248	8,395	8,420
第69計算期間末日　(2020年 9月15日)	3,065,927,768	3,074,894,045	8,548	8,573
第70計算期間末日　(2020年12月15日)	2,967,250,129	2,975,935,861	8,541	8,566
第71計算期間末日　(2021年 3月15日)	2,861,507,410	2,869,887,837	8,536	8,561
第72計算期間末日　(2021年 6月15日)	2,854,433,377	2,864,317,007	8,664	8,694
第73計算期間末日　(2021年 9月15日)	2,765,049,750	2,774,725,473	8,573	8,603
第74計算期間末日　(2021年12月15日)	2,723,226,929	2,727,966,913	8,618	8,633
第75計算期間末日　(2022年 3月15日)	2,584,339,988	2,589,007,921	8,305	8,320

第76計算期間末日　(2022年 6月15日)	2,585,598,220	2,590,214,305	8,402	8,417
第77計算期間末日　(2022年 9月15日)	2,650,430,188	2,657,997,359	8,756	8,781
第78計算期間末日　(2022年12月15日)	2,536,912,556	2,544,390,328	8,482	8,507
第79計算期間末日　(2023年 3月15日)	2,438,289,592	2,445,655,108	8,276	8,301
第80計算期間末日　(2023年 6月15日)	2,495,122,688	2,503,816,992	8,610	8,640
第81計算期間末日　(2023年 9月15日)	2,530,991,499	2,541,018,691	8,834	8,869
第82計算期間末日　(2023年12月15日)	2,523,635,049	2,533,523,351	8,932	8,967
第83計算期間末日　(2024年 3月15日)	2,527,547,150	2,538,590,515	9,155	9,195
2023年 3月末日	2,438,599,258	—	8,321	—
4月末日	2,446,188,928	—	8,377	—
5月末日	2,499,211,645	—	8,588	—
6月末日	2,574,943,496	—	8,895	—
7月末日	2,506,583,212	—	8,696	—
8月末日	2,563,277,710	—	8,927	—
9月末日	2,508,560,415	—	8,753	—
10月末日	2,495,164,848	—	8,739	—
11月末日	2,553,503,824	—	9,038	—
12月末日	2,528,469,109	—	9,007	—
2024年 1月末日	2,560,202,610	—	9,161	—
2月末日	2,569,069,944	—	9,274	—
3月末日	2,578,407,117	—	9,345	—

②【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第44計算期間	70円
第45計算期間	70円
第46計算期間	80円
第47計算期間	70円
第48計算期間	70円
第49計算期間	70円
第50計算期間	70円
第51計算期間	65円
第52計算期間	60円
第53計算期間	55円
第54計算期間	55円
第55計算期間	60円
第56計算期間	60円
第57計算期間	60円
第58計算期間	60円
第59計算期間	60円
第60計算期間	60円
第61計算期間	60円
第62計算期間	55円

第63計算期間	55円
第64計算期間	55円
第65計算期間	45円
第66計算期間	35円
第67計算期間	30円
第68計算期間	25円
第69計算期間	25円
第70計算期間	25円
第71計算期間	25円
第72計算期間	30円
第73計算期間	30円
第74計算期間	15円
第75計算期間	15円
第76計算期間	15円
第77計算期間	25円
第78計算期間	25円
第79計算期間	25円
第80計算期間	30円
第81計算期間	35円
第82計算期間	35円
第83計算期間	40円

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第44計算期間	0.96
第45計算期間	3.79
第46計算期間	10.91
第47計算期間	△3.86
第48計算期間	1.88
第49計算期間	△1.23
第50計算期間	△0.72
第51計算期間	△4.31
第52計算期間	△4.76
第53計算期間	△3.05
第54計算期間	6.78
第55計算期間	△2.90
第56計算期間	0.92
第57計算期間	3.07
第58計算期間	1.61
第59計算期間	△4.57
第60計算期間	0.14
第61計算期間	1.14
第62計算期間	0.48

第63計算期間	0.56
第64計算期間	△0.40
第65計算期間	1.20
第66計算期間	1.53
第67計算期間	△0.42
第68計算期間	2.29
第69計算期間	2.12
第70計算期間	0.21
第71計算期間	0.23
第72計算期間	1.85
第73計算期間	△0.70
第74計算期間	0.69
第75計算期間	△3.45
第76計算期間	1.34
第77計算期間	4.51
第78計算期間	△2.84
第79計算期間	△2.13
第80計算期間	4.39
第81計算期間	3.00
第82計算期間	1.50
第83計算期間	2.94

（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44計算期間	5,777,983	449,635,221	8,786,558,913
第45計算期間	8,134,017	470,649,342	8,324,043,588
第46計算期間	5,236,555	570,276,452	7,759,003,691
第47計算期間	5,262,487	325,926,398	7,438,339,780
第48計算期間	4,378,133	376,932,031	7,065,785,882
第49計算期間	3,663,087	255,525,874	6,813,923,095
第50計算期間	3,529,118	303,398,893	6,514,053,320
第51計算期間	3,912,938	195,264,760	6,322,701,498
第52計算期間	3,349,742	186,129,481	6,139,921,759
第53計算期間	3,279,316	144,801,775	5,998,399,300
第54計算期間	4,747,566	218,851,577	5,784,295,289
第55計算期間	3,008,855	274,772,562	5,512,531,582
第56計算期間	3,101,261	196,824,142	5,318,808,701
第57計算期間	4,636,353	172,788,263	5,150,656,791
第58計算期間	2,583,787	259,412,016	4,893,828,562
第59計算期間	3,572,860	150,486,345	4,746,915,077
第60計算期間	2,622,560	117,017,818	4,632,519,819
第61計算期間	3,199,108	117,312,004	4,518,406,923

第62計算期間	2,199,126	234,324,796	4,286,281,253
第63計算期間	2,739,576	126,793,551	4,162,227,278
第64計算期間	1,723,756	134,730,348	4,029,220,686
第65計算期間	2,016,088	59,366,268	3,971,870,506
第66計算期間	1,485,531	72,956,289	3,900,399,748
第67計算期間	2,464,466	171,348,846	3,731,515,368
第68計算期間	1,043,787	57,466,005	3,675,093,150
第69計算期間	1,214,472	89,796,478	3,586,511,144
第70計算期間	1,558,140	113,776,240	3,474,293,044
第71計算期間	1,360,895	123,482,851	3,352,171,088
第72計算期間	1,252,739	58,880,359	3,294,543,468
第73計算期間	1,451,778	70,754,022	3,225,241,224
第74計算期間	2,083,449	67,334,803	3,159,989,870
第75計算期間	1,167,060	49,201,388	3,111,955,542
第76計算期間	1,122,849	35,687,734	3,077,390,657
第77計算期間	3,584,254	54,106,501	3,026,868,410
第78計算期間	2,393,599	38,153,164	2,991,108,845
第79計算期間	2,575,598	47,477,819	2,946,206,624
第80計算期間	1,082,695	49,187,910	2,898,101,409
第81計算期間	8,719,189	41,908,450	2,864,912,148
第82計算期間	13,346,148	53,028,965	2,825,229,331
第83計算期間	7,834,211	72,222,175	2,760,841,367

（参考）

外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

2024年 3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	269,934,026,904	46.10
	中国	50,121,877,935	8.56
	フランス	46,493,803,552	7.94
	イタリア	41,886,517,896	7.15
	ドイツ	35,520,915,818	6.07
	イギリス	29,963,966,922	5.12
	スペイン	28,373,640,259	4.85
	カナダ	11,875,134,138	2.03
	ベルギー	10,211,677,275	1.74
	オランダ	8,681,190,906	1.48
	オーストラリア	7,814,127,730	1.33
	オーストリア	6,975,967,383	1.19
	メキシコ	5,095,884,421	0.87

	ポーランド	3,116,644,025	0.53
	マレーシア	2,923,549,196	0.50
	アイルランド	2,904,037,299	0.50
	フィンランド	2,876,684,482	0.49
	シンガポール	2,237,092,187	0.38
	イスラエル	1,871,761,941	0.32
	デンマーク	1,538,258,395	0.26
	ニュージーランド	1,386,189,581	0.24
	スウェーデン	1,017,335,411	0.17
	ノルウェー	824,198,687	0.14
	小計	573,644,482,343	97.97
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	11,900,315,854	2.03
純資産総額		585,544,798,197	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

ａ評価額上位３０銘柄

2024年 3月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限(年/月/日)	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	4.5 T-NOTE 331115	18,630,000	15,621.72	2,910,326,457	15,480.48	2,884,015,222	4.500000	2033/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	3.875 T-NOTE 330815	18,320,000	14,421.75	2,642,065,754	14,742.36	2,700,801,437	3.875000	2033/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 310815	19,990,000	12,817.29	2,562,177,378	12,336.66	2,466,098,754	1.250000	2031/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	4.125 T-NOTE 321115	16,070,000	15,969.37	2,566,277,833	15,040.15	2,416,953,473	4.125000	2032/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 320815	17,340,000	14,190.94	2,460,709,368	13,582.54	2,355,212,706	2.750000	2032/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	3.5 T-NOTE 330215	16,290,000	15,204.15	2,476,757,516	14,342.54	2,336,401,190	3.500000	2033/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	3.375 T-NOTE 330515	16,100,000	14,574.81	2,346,545,589	14,186.70	2,284,059,189	3.375000	2033/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 320515	16,180,000	14,495.44	2,345,362,571	13,749.92	2,224,737,157	2.875000	2032/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	1.875 T-NOTE 320215	16,860,000	13,351.43	2,251,052,139	12,791.48	2,156,644,119	1.875000	2032/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 311115	17,420,000	12,892.38	2,245,853,093	12,370.37	2,154,919,227	1.375000	2031/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	0.875 T-NOTE 301115	17,430,000	12,707.42	2,214,904,668	12,258.88	2,136,724,008	0.875000	2030/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 310515	16,640,000	13,321.68	2,216,728,278	12,763.98	2,123,926,479	1.625000	2031/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	4.25 T-NOTE 270315	14,000,000	15,079.67	2,111,155,053	15,079.67	2,111,155,053	4.250000	2027/3/15	0.36
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 310215	16,920,000	12,782.19	2,162,747,556	12,419.76	2,101,423,417	1.125000	2031/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	4.25 T-NOTE 251231	13,580,000	15,051.47	2,043,990,179	15,017.97	2,039,441,599	4.250000	2025/12/31	0.35
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300815	16,160,000	12,473.38	2,015,699,334	12,128.76	1,960,009,080	0.625000	2030/8/15	0.33
アメリカ	国債証券	0.75 T-NOTE 260331	13,590,000	14,010.09	1,903,972,243	14,031.44	1,906,873,862	0.750000	2026/3/31	0.33

アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 270131	13,540,000	14,056.87	1,903,300,919	13,965.20	1,890,888,989	1.500000	2027/1/31	0.32
フランス	国債証券	2.5 O.A.T 300525	11,270,000	16,249.14	1,831,278,668	16,207.50	1,826,586,171	2.500000	2030/5/25	0.31
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300515	14,210,000	12,530.79	1,780,626,366	12,231.68	1,738,121,794	0.625000	2030/5/15	0.30
アメリカ	国債証券	4.75 T-BOND 531115	10,670,000	16,290.95	1,738,244,397	16,166.56	1,724,972,609	4.750000	2053/11/15	0.29
アメリカ	国債証券	4 T-NOTE 340215	11,450,000	14,874.00	1,703,073,307	14,892.59	1,705,201,894	4.000000	2034/2/15	0.29
フランス	国債証券	2.75 O.A.T 271025	10,320,000	16,480.31	1,700,768,696	16,354.42	1,687,776,963	2.750000	2027/10/25	0.29
フランス	国債証券	1.5 O.A.T 310525	10,790,000	15,022.55	1,620,933,184	15,122.45	1,631,712,966	1.500000	2031/5/25	0.28
フランス	国債証券	0.5 O.A.T 260525	10,240,000	15,403.02	1,577,269,395	15,534.17	1,590,699,990	0.500000	2026/5/25	0.27
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 261130	11,360,000	13,964.15	1,586,328,206	13,924.98	1,581,878,687	1.250000	2026/11/30	0.27
フランス	国債証券	0.75 O.A.T 281125	10,340,000	14,849.90	1,535,479,743	14,997.69	1,550,761,283	0.750000	2028/11/25	0.26
アメリカ	国債証券	4 T-NOTE 290131	10,050,000	15,170.07	1,524,592,553	14,987.22	1,506,216,033	4.000000	2029/1/31	0.26
アメリカ	国債証券	4.125 T-BOND 530815	10,300,000	13,992.55	1,441,233,316	14,556.65	1,499,335,159	4.125000	2053/8/15	0.26
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 251115	10,290,000	14,611.65	1,503,539,443	14,546.59	1,496,844,882	2.250000	2025/11/15	0.26

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

ｂ全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年 3月29日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	97.97
合計	97.97

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

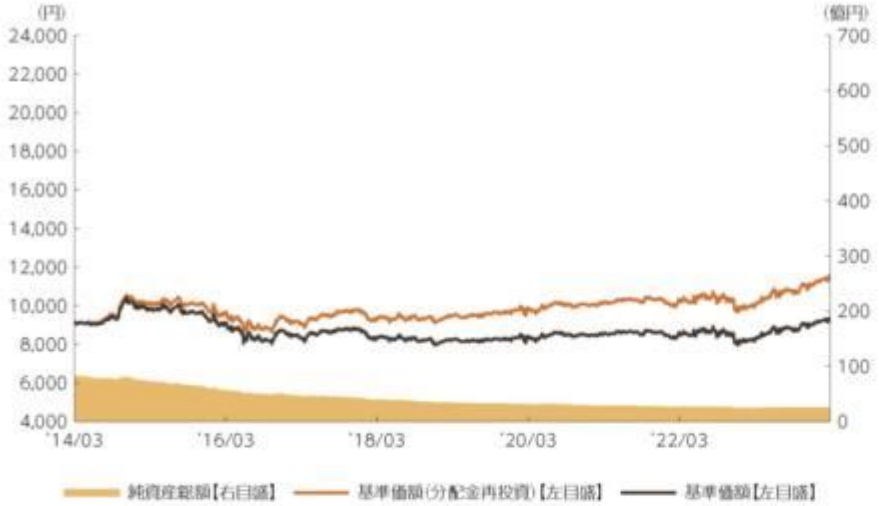
該当事項はありません。

≪参考情報≫

運用実績

2024年3月29日現在

■基準価額・純資産の推移　2014年3月31日～2024年3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	9,345円
純資産総額	25.7億円

•純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2024 年　3月	40円
2023 年 12月	35円
2023 年　9月	35円
2023 年　6月	30円
2023 年　3月	25円
2022 年 12月	25円
直近1年間累計	140円
設定来累計	5,900円

•分配金は1万口当たり、税引前

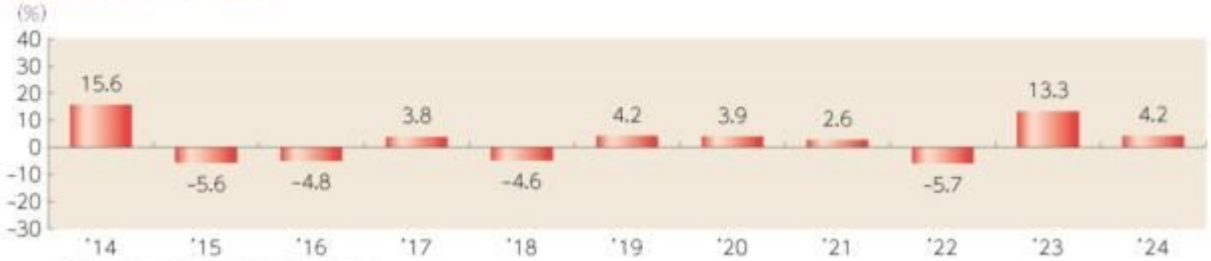
■主要な資産の状況

種別構成	比率
国債	98.0%
コールローン他 (負債控除後)	2.0%
合計	100.0%

	組入上位銘柄	種別	国・地域	比率
1	4.5 T-NOTE 331115	国債	アメリカ	0.5%
2	3.875 T-NOTE 330815	国債	アメリカ	0.5%
3	1.25 T-NOTE 310815	国債	アメリカ	0.4%
4	4.125 T-NOTE 321115	国債	アメリカ	0.4%
5	2.75 T-NOTE 320815	国債	アメリカ	0.4%
6	3.5 T-NOTE 330215	国債	アメリカ	0.4%
7	3.375 T-NOTE 330515	国債	アメリカ	0.4%
8	2.875 T-NOTE 320515	国債	アメリカ	0.4%
9	1.875 T-NOTE 320215	国債	アメリカ	0.4%
10	1.375 T-NOTE 311115	国債	アメリカ	0.4%

•各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
•コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。
•「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
•2024年は年初から3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２【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

＜訂正前＞

①申込みの受付
原則として、いつでも申込みができます。
取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

②申込単位
販売会社が定める単位

③申込価額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額

④申込価額の算出頻度
原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑤申込単位・申込価額の照会方法
申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。
また、下記においてもご照会いただけます。
三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社
お客様専用フリーダイヤル　0120-151034
（受付時間：営業日の9:00～17:00）
なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。
ホームページアドレス　https://www.am.mufg.jp/

⑥申込手数料
申込価額（発行価格）×2.2%（税抜　２%）を上限として販売会社が定める手数料率
申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があり、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

⑦申込方法
取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。
取得申込者は、申込金額および申込手数料（税込）を販売会社が定める日までに支払うものとします。
なお、申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があります。申込みコースの取扱いは販売会社により異なる場合があります。

⑧申込受付時間
取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後３時までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。

⑨取得申込みの受付の中止および取消し
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことがあります。

※申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

＜訂正後＞

①申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。
取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

②申込単位
販売会社が定める単位

③申込価額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額

④申込価額の算出頻度
原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑤申込単位・申込価額の照会方法
申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。
また、下記においてもご照会いただけます。
三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社
お客様専用フリーダイヤル　0120-151034
（受付時間：営業日の9:00～17:00）
なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。
ホームページアドレス　https://www.am.mufg.jp/

⑥申込手数料
申込価額（発行価格）×2.2%（税抜　２%）を上限として販売会社が定める手数料率
申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があり、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

⑦申込方法
取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。
取得申込者は、申込金額および申込手数料（税込）を販売会社が定める日までに支払うものとします。
なお、申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があります。申込みコースの取扱いは販売会社により異なる場合があります。

⑧申込受付時間
取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後３時までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。

ただし、2024年11月５日以降は、以下の通りとなります。
取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後３時30分までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に取得申込みを締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

⑨取得申込みの受付の中止および取消し
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことがあります。

※申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

２【換金（解約）手続等】

＜訂正前＞

①解約の受付
原則として、いつでも解約の請求ができます。
受益者の解約請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

②解約単位
１口単位

③解約価額
解約請求受付日の翌営業日の基準価額

④信託財産留保額
ありません。

⑤解約価額の算出頻度
原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑥解約価額の照会方法
解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。
なお、下記においてもご照会いただけます。
三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社
お客様専用フリーダイヤル　0120-151034
（受付時間：営業日の9:00～17:00）
ホームページアドレス　https://www.am.mufg.jp/

⑦支払開始日
解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して５営業日目から販売会社において支払います。

⑧解約請求受付時間
解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後３時までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。

⑨解約請求受付の中止および取消し
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとします。
また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

＜訂正後＞

①解約の受付
原則として、いつでも解約の請求ができます。
受益者の解約請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

②解約単位
　１口単位

③解約価額
　解約請求受付日の翌営業日の基準価額

④信託財産留保額
　ありません。

⑤解約価額の算出頻度
　原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑥解約価額の照会方法
　解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。
　なお、下記においてもご照会いただけます。
　　三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社
　　お客様専用フリーダイヤル　0120-151034
　　（受付時間：営業日の9:00～17:00）
　　ホームページアドレス　https://www.am.mufg.jp/

⑦支払開始日
　解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して５営業日目から販売会社において支払います。

⑧解約請求受付時間
　解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後３時までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。

　ただし、2024年11月５日以降は、以下の通りとなります。
　解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後３時30分までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に解約請求を締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

⑨解約請求受付の中止および取消し
　委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとします。
　また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

　※換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

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　四半期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（2023年 9月16日から2024年 3月15日まで）の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により監査を受けております。

１【財務諸表】

【ワールド・インカムオープン】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 ［ 2023年 9月15日現在 ］	当期 ［ 2024年 3月15日現在 ］
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,672,093	5,728,321
親投資信託受益証券	2,530,219,138	2,526,774,158
未収入金	11,191,324	14,001,796
流動資産合計	2,547,082,555	2,546,504,275
資産合計	2,547,082,555	2,546,504,275
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	10,027,192	11,043,365
未払解約金	817,102	2,673,064
未払受託者報酬	349,783	349,385
未払委託者報酬	4,896,971	4,891,311
未払利息	8	-
流動負債合計	16,091,056	18,957,125
負債合計	16,091,056	18,957,125
純資産の部		
元本等		
元本	2,864,912,148	2,760,841,367
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△333,920,649	△233,294,217
（分配準備積立金）	49,191,706	54,899,562
元本等合計	2,530,991,499	2,527,547,150
純資産合計	2,530,991,499	2,527,547,150
負債純資産合計	2,547,082,555	2,546,504,275

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自　2023年 3月16日 至　2023年 9月15日	当期 自　2023年 9月16日 至　2024年 3月15日
営業収益		

	前期 自　2023年 3月16日 至　2023年 9月15日	当期 自　2023年 9月16日 至　2024年 3月15日
受取利息	8	4
有価証券売買等損益	191,442,256	122,480,232
営業収益合計	191,442,264	122,480,236
営業費用		
支払利息	801	122
受託者報酬	689,877	695,034
委託者報酬	9,658,272	9,730,335
営業費用合計	10,348,950	10,425,491
営業利益又は営業損失（△）	181,093,314	112,054,745
経常利益又は経常損失（△）	181,093,314	112,054,745
当期純利益又は当期純損失（△）	181,093,314	112,054,745
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（△）	1,440,288	2,317,433
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△507,917,032	△333,920,649
剰余金増加額又は欠損金減少額	14,306,603	13,887,849
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	14,306,603	13,887,849
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,241,750	2,067,062
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,241,750	2,067,062
分配金	18,721,496	20,931,667
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△333,920,649	△233,294,217

（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。

（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 [2023年 9月15日現在]	当期 [2024年 3月15日現在]
１．　期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	2,946,206,624円 9,801,884円 91,096,360円	2,864,912,148円 21,180,359円 125,251,140円
２．　元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	333,920,649円	233,294,217円
３．　受益権の総数	2,864,912,148口	2,760,841,367口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期
自 2023年 3月16日
至 2023年 9月15日

１.分配金の計算過程

第80期
2023年 3月16日
2023年 6月15日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	13,645,182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	35,600,387円
分配準備積立金額	D	40,498,948円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	89,744,517円
当ファンドの期末残存口数	F	2,898,101,409口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	309円
1万口当たり分配金額	H	30円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	8,694,304円

第81期

当期
自 2023年 9月16日
至 2024年 3月15日

１.分配金の計算過程

第82期
2023年 9月16日
2023年12月15日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	13,870,750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
収益調整金額	C	35,083,438円
分配準備積立金額	D	48,282,597円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	97,236,785円
当ファンドの期末残存口数	F	2,825,229,331口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	344円
1万口当たり分配金額	H	35円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	9,888,302円

第83期

前期 自 2023年 3月16日 至 2023年 9月15日	当期 自 2023年 9月16日 至 2024年 3月15日
2023年 6月16日 2023年 9月15日	2023年12月16日 2024年 3月15日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	14,425,416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	一円
収益調整金額	C	35,334,709円
分配準備積立金額	D	44,793,482円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	94,553,607円
当ファンドの期末残存口数	F	2,864,912,148口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	330円
1万口当たり分配金額	H	35円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	10,027,192円

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	15,011,377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	一円
収益調整金額	C	34,431,377円
分配準備積立金額	D	50,931,550円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	100,374,304円
当ファンドの期末残存口数	F	2,760,841,367口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	363円
1万口当たり分配金額	H	40円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	11,043,365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 2023年 3月16日 至 2023年 9月15日	当期 自 2023年 9月16日 至 2024年 3月15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、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同左

2　金融商品の時価等に関する事項

区分	前期 ［2023年 9月15日現在］	当期 ［2024年 3月15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	（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。	同左
	（２）デリバティブ取引	（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。	同左
	（３）上記以外の金融商品	（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。	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

	前期 ［2023年 9月15日現在］	当期 ［2024年 3月15日現在］

種類	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	79,381,201	77,310,436
合計	79,381,201	77,310,436

（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 ［2023年 9月15日現在］	当期 ［2024年 3月15日現在］
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8834円 (8,834円)	0.9155円 (9,155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	974,910,934	2,526,774,158	
合計		974,910,934	2,526,774,158	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

外国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	［2024年 3月15日現在］
資産の部	
流動資産	
預金	2,953,884,083
コール・ローン	3,811,462,722
国債証券	540,112,813,383
派生商品評価勘定	134,995,631
未収入金	592,612
未収利息	4,010,127,347
前払費用	483,924,567
流動資産合計	551,507,800,345

	［2024年 3月15日現在］
資産合計	551,507,800,345
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	99,838
未払金	203,603,291
未払解約金	613,934,906
未払利息	274
流動負債合計	817,638,309
負債合計	817,638,309
純資産の部	
元本等	
元本	212,476,774,771
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	338,213,387,265
元本等合計	550,690,162,036
純資産合計	550,690,162,036
負債純資産合計	551,507,800,345

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 3月15日現在]
１． 期首	2023年 9月16日
期首元本額	192,248,041,771円
期中追加設定元本額	29,084,458,660円
期中一部解約元本額	8,855,725,660円
元本の内訳※	
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）	282,664,779円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）	676,599,280円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）	443,608,019円
三菱ＵＦＪ 外国債券オープン	816,780,534円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	2,119,675,212円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	6,308,738,674円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	5,135,263,654円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）	535,712,494円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）	96,843,180円
ファンド・マネジャー（海外債券）	557,684,832円
ｅＭＡＸＩＳ 先進国債券インデックス	6,196,643,802円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	2,357,499,046円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	208,514,253円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	1,047,749,979円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３０（確定拠出年金）	424,611,981円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４０（確定拠出年金）	248,477,186円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５０（確定拠出年金）	168,900,212円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 先進国債券インデックス	43,906,186,655円
海外債券セレクション（ラップ向け）	5,794,847,787円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	12,101,050,169円

	[2024年 3月15日現在]
つみたて８資産均等バランス	6,013,958,188円
つみたて４資産均等バランス	2,226,555,048円
ｅＭＡＸＩＳ　マイマネージャー　１９７０ｓ	4,782,712円
ｅＭＡＸＩＳ　マイマネージャー　１９８０ｓ	3,794,303円
ｅＭＡＸＩＳ　マイマネージャー　１９９０ｓ	608,221円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０３５（確定拠出年金）	240,014,641円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０４５（確定拠出年金）	165,188,601円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０５５（確定拠出年金）	94,854,895円
三菱ＵＦＪ　ＤＣ年金バランス（株式１５）	799,947,810円
三菱ＵＦＪ　ＤＣ年金バランス（株式４０）	1,264,244,212円
三菱ＵＦＪ　ＤＣ年金バランス（株式６５）	1,976,131,488円
三菱ＵＦＪ　ＤＣ年金インデックス（先進国債券）	2,149,969,694円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金）	82,917,310円
三菱ＵＦＪ　ＤＣ年金バランス（株式２５）	178,956,181円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０６５（確定拠出年金）	38,682,147円
ラップ向けインデックスｆ　先進国債券	2,856,200,333円
三菱ＵＦＪ　ＤＣ年金バランス（株式８０）	37,081,553円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	2,743,048,691円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	63,659,340円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	28,301,133円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	37,863,530円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０７０（確定拠出年金）	221,341円
三菱ＵＦＪ　外国債券オープン（確定拠出年金）	3,100,406,756円
三菱ＵＦＪ　外国債券オープン（毎月分配型）	16,485,151,860円
ワールド・インカムオープン	974,910,934円
三菱ＵＦＪ　ＤＣ海外債券インデックスファンド	15,632,367,557円
三菱ＵＦＪ　世界国債インデックスファンド（毎月分配型）	399,232,739円
三菱ＵＦＪ　世界国債インデックスファンド（年１回決算型）	2,221,804,370円
ｅＭＡＸＩＳ　バランス（４資産均等型）	903,910,647円
ｅＭＡＸＩＳ　最適化バランス（マイゴールキーパー）	531,666,631円
ｅＭＡＸＩＳ　最適化バランス（マイディフェンダー）	292,095,771円
ｅＭＡＸＩＳ　最適化バランス（マイミッドフィルダー）	541,594,793円
ｅＭＡＸＩＳ　最適化バランス（マイフォワード）	219,654,111円
ｅＭＡＸＩＳ　最適化バランス（マイストライカー）	78,214,879円
三菱ＵＦＪ　外国債券ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	1,014,996,098円
三菱ＵＦＪ　外国債券ファンドＶＡ２（適格機関投資家限定）	10,373,291円
ＭＵＡＭ　世界債券オープン（適格機関投資家限定）	967,836,612円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,493,743円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,504,632,446円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　４０型（適格機関投資家限定）	1,130,484,757円
ＭＵＡＭ　外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	41,427,628,494円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　５０型（適格機関投資家限定）	467,050,008円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	387,608円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　３０型（適格機関投資家限定）	102,190円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,233,568,783円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	60,325,677円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	106,218,802円
ＭＵＫＡＭ　スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	1,006,308,405円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	33,071,600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）	2,485,915,549円
ＭＵＫＡＭ　スマート・クオリティ・セレクション２（適格機関投資家限定）	655,362,166円
外国債券インデックスファンドＶ（適格機関投資家限定）	640,419,840円
海外債券インデックスファンドＳ	4,702,775,266円
グローバルバランスオープンＶ（適格機関投資家限定）	952,758円

	[2024年 3月15日現在]
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	1,615,555円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	2,621,826円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	509,498円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	874,454円
三菱ＵＦＪ　外国債券インデックスファンドＶＡ	4,353,260円
三菱ＵＦＪ　バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	3,568,329円
三菱ＵＦＪ　バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	7,627,796円
三菱ＵＦＪ　バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	3,410,899円
三菱ＵＦＪ　バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	8,804,162円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞外国債券インデックスファンド	1,752,514,995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）	194,198,372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）	559,481,964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）	466,877,453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）	194,367,967円
合計	212,476,774,771円
２．　受益権の総数	212,476,774,771口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

１　金融商品の状況に関する事項

区分	自 2023年 9月16日 至 2024年 3月15日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第２条第４項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
２.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
３.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

２　金融商品の時価等に関する事項

区分	［2024年 3月15日現在］
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
２.時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	［2024年 3月15日現在］
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

国債証券	△6,927,995,592
合計	△6,927,995,592

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

［2024年 3月15日現在］

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	3,316,504,410	—	3,451,425,130	134,920,720
	カナダドル	19,744,280	—	19,749,814	5,534
	オーストラリアドル	19,535,355	—	19,515,298	△20,057
	イギリスポンド	54,844,146	—	54,866,004	21,858
	シンガポールドル	6,668,280	—	6,667,626	△654
	マレーシアリンギット	12,008,000	—	11,995,460	△12,540
	ニュージーランドドル	4,550,200	—	4,538,870	△11,330
	メキシコペソ	13,304,625	—	13,325,850	21,225
	ポーランドズロチ	7,890,876	—	7,889,847	△1,029
	中国元	126,320,472	—	126,295,380	△25,092
	ユーロ	328,067,314	—	328,064,472	△2,842
合計		3,909,437,958	—	4,044,333,751	134,895,793

（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）

	［2024年 3月15日現在］
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5918円 (25,918円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨	種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
アメリカドル	国債証券	0.25 T-NOTE 250531	5,000,000.00	4,724,316.40	
		0.25 T-NOTE 250630	6,650,000.00	6,262,949.25	
		0.25 T-NOTE 250731	5,800,000.00	5,443,390.59	
		0.25 T-NOTE 250831	6,700,000.00	6,266,855.45	
		0.25 T-NOTE 250930	7,600,000.00	7,084,921.85	
		0.25 T-NOTE 251031	10,300,000.00	9,571,154.28	
		0.375 T-NOTE 250430	4,670,000.00	4,436,408.79	
		0.375 T-NOTE 251130	10,150,000.00	9,420,865.20	
		0.375 T-NOTE 251231	8,500,000.00	7,866,152.36	
		0.375 T-NOTE 260131	9,200,000.00	8,485,921.85	
		0.375 T-NOTE 270731	7,150,000.00	6,249,965.79	
		0.375 T-NOTE 270930	7,300,000.00	6,342,302.70	
		0.5 T-NOTE 260228	9,900,000.00	9,129,656.25	
		0.5 T-NOTE 270430	5,280,000.00	4,676,100.00	
		0.5 T-NOTE 270531	5,490,000.00	4,845,782.81	
		0.5 T-NOTE 270630	5,900,000.00	5,195,341.81	
		0.5 T-NOTE 270831	4,950,000.00	4,333,570.31	
		0.5 T-NOTE 271031	6,140,000.00	5,342,279.64	
		0.625 T-NOTE 260731	7,930,000.00	7,230,704.13	
		0.625 T-NOTE 270331	3,800,000.00	3,390,164.07	
		0.625 T-NOTE 271130	7,550,000.00	6,583,983.38	
		0.625 T-NOTE 271231	8,630,000.00	7,504,223.23	
		0.625 T-NOTE 300515	12,090,000.00	9,703,641.82	
		0.625 T-NOTE 300815	16,160,000.00	12,856,353.18	
		0.75 T-NOTE 260331	8,100,000.00	7,489,810.55	
		0.75 T-NOTE 260430	9,200,000.00	8,481,609.35	
		0.75 T-NOTE 260531	8,200,000.00	7,539,195.29	
		0.75 T-NOTE 260831	10,100,000.00	9,212,896.49	
		0.75 T-NOTE 280131	9,950,000.00	8,673,018.58	
		0.875 T-NOTE 260630	8,300,000.00	7,636,972.67	
		0.875 T-NOTE 260930	10,000,000.00	9,130,859.40	
		0.875 T-NOTE 301115	17,430,000.00	14,019,235.01	
		1 T-NOTE 280731	9,150,000.00	7,940,126.97	
		1.125 T-BOND 400515	6,020,000.00	3,698,890.21	
		1.125 T-BOND 400815	7,550,000.00	4,597,242.18	
		1.125 T-NOTE 261031	10,450,000.00	9,575,016.58	
		1.125 T-NOTE 270228	2,950,000.00	2,678,738.29	
		1.125 T-NOTE 280229	9,760,000.00	8,617,203.16	
		1.125 T-NOTE 280831	9,430,000.00	8,209,257.07	
		1.125 T-NOTE 310215	16,920,000.00	13,783,521.15	

		1.25 T-BOND 500515	9,420,000.00	4,720,671.07	
		1.25 T-NOTE 261130	11,360,000.00	10,420,581.27	
		1.25 T-NOTE 261231	8,200,000.00	7,511,167.93	
		1.25 T-NOTE 280331	9,950,000.00	8,807,499.01	
		1.25 T-NOTE 280430	9,740,000.00	8,601,827.71	
		1.25 T-NOTE 280531	9,750,000.00	8,592,949.17	
		1.25 T-NOTE 280630	9,680,000.00	8,513,295.34	
		1.25 T-NOTE 280930	10,700,000.00	9,348,080.03	
		1.25 T-NOTE 310815	17,720,000.00	14,328,281.25	
		1.375 T-BOND 401115	8,400,000.00	5,314,476.55	
		1.375 T-BOND 500815	10,430,000.00	5,400,376.97	
		1.375 T-NOTE 260831	3,800,000.00	3,521,011.71	
		1.375 T-NOTE 281031	8,250,000.00	7,235,668.93	
		1.375 T-NOTE 281231	8,700,000.00	7,599,585.89	
		1.375 T-NOTE 311115	17,420,000.00	14,125,510.60	
		1.5 T-NOTE 260815	9,740,000.00	9,059,531.65	
		1.5 T-NOTE 270131	13,540,000.00	12,455,477.68	
		1.5 T-NOTE 281130	9,700,000.00	8,541,115.19	
		1.5 T-NOTE 300215	8,740,000.00	7,470,992.99	
		1.625 T-BOND 501115	10,710,000.00	5,934,846.03	
		1.625 T-NOTE 260215	9,760,000.00	9,214,431.22	
		1.625 T-NOTE 260515	7,670,000.00	7,198,265.01	
		1.625 T-NOTE 260930	2,100,000.00	1,955,501.96	
		1.625 T-NOTE 261031	3,350,000.00	3,111,116.22	
		1.625 T-NOTE 261130	3,400,000.00	3,152,171.89	
		1.625 T-NOTE 290815	7,050,000.00	6,161,727.56	
		1.625 T-NOTE 310515	16,640,000.00	13,926,574.93	
		1.75 T-BOND 410815	11,770,000.00	7,813,486.95	
		1.75 T-NOTE 261231	4,700,000.00	4,364,941.41	
		1.75 T-NOTE 290131	8,600,000.00	7,636,027.37	
		1.75 T-NOTE 291115	5,150,000.00	4,511,279.28	
		1.875 T-BOND 410215	10,700,000.00	7,343,083.97	
		1.875 T-BOND 510215	11,810,000.00	6,979,663.82	
		1.875 T-BOND 511115	10,930,000.00	6,428,633.16	
		1.875 T-NOTE 260630	3,500,000.00	3,296,015.62	
		1.875 T-NOTE 260731	5,500,000.00	5,167,529.29	
		1.875 T-NOTE 270228	9,120,000.00	8,466,993.77	
		1.875 T-NOTE 290228	7,800,000.00	6,957,234.33	
		1.875 T-NOTE 320215	16,860,000.00	14,137,373.35	
		2 T-BOND 411115	10,220,000.00	7,055,991.82	
		2 T-BOND 500215	7,790,000.00	4,790,697.86	
		2 T-BOND 510815	12,060,000.00	7,333,751.96	
			11,490,000.00	11,041,620.67	

		2 T-NOTE 250815			
		2 T-NOTE 261115	8,680,000.00	8,133,939.80	
		2.125 T-NOTE 250515	6,970,000.00	6,746,469.93	
		2.125 T-NOTE 260531	5,000,000.00	4,740,429.70	
		2.25 T-BOND 410515	9,320,000.00	6,780,117.97	
		2.25 T-BOND 460815	5,040,000.00	3,396,979.70	
		2.25 T-BOND 490815	6,950,000.00	4,553,200.20	
		2.25 T-BOND 520215	9,890,000.00	6,385,617.55	
		2.25 T-NOTE 251115	10,290,000.00	9,872,973.67	
		2.25 T-NOTE 260331	4,500,000.00	4,290,380.86	
		2.25 T-NOTE 270215	6,810,000.00	6,396,212.68	
		2.25 T-NOTE 270815	6,190,000.00	5,766,250.98	
		2.25 T-NOTE 271115	7,500,000.00	6,958,886.69	
		2.375 T-BOND 420215	7,850,000.00	5,749,205.05	
		2.375 T-BOND 491115	6,600,000.00	4,441,464.83	
		2.375 T-BOND 510515	11,570,000.00	7,711,450.23	
		2.375 T-NOTE 260430	4,000,000.00	3,816,406.24	
		2.375 T-NOTE 270515	9,070,000.00	8,513,931.08	
		2.375 T-NOTE 290331	7,500,000.00	6,844,335.90	
		2.375 T-NOTE 290515	7,480,000.00	6,813,812.50	
		2.5 T-BOND 450215	5,050,000.00	3,640,734.37	
		2.5 T-BOND 460215	4,030,000.00	2,870,666.60	
		2.5 T-BOND 460515	4,210,000.00	2,991,977.91	
		2.5 T-NOTE 260228	3,450,000.00	3,309,978.50	
		2.5 T-NOTE 270331	7,700,000.00	7,275,597.63	
		2.625 T-NOTE 250331	1,960,000.00	1,912,225.96	
		2.625 T-NOTE 251231	3,200,000.00	3,084,062.49	
		2.625 T-NOTE 260131	3,900,000.00	3,754,892.58	
		2.625 T-NOTE 270531	7,900,000.00	7,472,443.38	
		2.625 T-NOTE 290215	9,640,000.00	8,920,765.57	
		2.625 T-NOTE 290731	5,600,000.00	5,150,687.47	
		2.75 T-BOND 420815	2,520,000.00	1,951,966.39	
		2.75 T-BOND 421115	3,700,000.00	2,856,515.62	
		2.75 T-BOND 470815	5,190,000.00	3,825,901.76	
		2.75 T-BOND 471115	5,110,000.00	3,760,241.43	
		2.75 T-NOTE 250515	6,400,000.00	6,238,374.97	
		2.75 T-NOTE 250630	2,370,000.00	2,305,889.65	
		2.75 T-NOTE 250831	4,050,000.00	3,929,923.81	
		2.75 T-NOTE 270430	6,400,000.00	6,084,124.99	
		2.75 T-NOTE 270731	7,650,000.00	7,248,823.21	
		2.75 T-NOTE 280215	9,990,000.00	9,406,989.79	
		2.75 T-NOTE 290531	7,160,000.00	6,641,039.82	
		2.75 T-NOTE 320815	15,460,000.00	13,772,686.01	

		2.875 T-BOND 430515	4,680,000.00	3,666,578.90	
		2.875 T-BOND 450815	3,500,000.00	2,686,250.00	
		2.875 T-BOND 461115	2,340,000.00	1,776,891.79	
		2.875 T-BOND 490515	7,170,000.00	5,368,677.53	
		2.875 T-BOND 520515	9,430,000.00	7,012,641.54	
		2.875 T-NOTE 250430	6,000,000.00	5,861,953.14	
		2.875 T-NOTE 250531	4,230,000.00	4,126,067.58	
		2.875 T-NOTE 250615	7,800,000.00	7,605,152.33	
		2.875 T-NOTE 250731	6,100,000.00	5,937,253.89	
		2.875 T-NOTE 251130	3,800,000.00	3,681,992.17	
		2.875 T-NOTE 280515	10,090,000.00	9,522,437.50	
		2.875 T-NOTE 280815	10,310,000.00	9,703,482.08	
		2.875 T-NOTE 290430	7,000,000.00	6,539,257.83	
		2.875 T-NOTE 320515	15,480,000.00	13,963,141.42	
		3 T-BOND 420515	2,270,000.00	1,833,157.99	
		3 T-BOND 441115	3,900,000.00	3,078,333.98	
		3 T-BOND 450515	2,790,000.00	2,193,964.45	
		3 T-BOND 451115	2,000,000.00	1,565,664.06	
		3 T-BOND 470215	4,590,000.00	3,558,146.46	
		3 T-BOND 470515	3,390,000.00	2,624,667.76	
		3 T-BOND 480215	5,970,000.00	4,598,532.43	
		3 T-BOND 480815	7,070,000.00	5,433,819.73	
		3 T-BOND 490215	7,450,000.00	5,717,147.41	
		3 T-BOND 520815	9,080,000.00	6,930,593.74	
		3 T-NOTE 250715	6,700,000.00	6,534,855.45	
		3 T-NOTE 250930	5,400,000.00	5,253,820.32	
		3 T-NOTE 251031	3,300,000.00	3,206,414.04	
		3.125 T-BOND 411115	1,990,000.00	1,651,311.33	
		3.125 T-BOND 420215	2,200,000.00	1,818,308.60	
		3.125 T-BOND 430215	3,160,000.00	2,581,942.17	
		3.125 T-BOND 440815	4,350,000.00	3,512,200.16	
		3.125 T-BOND 480515	6,010,000.00	4,732,992.37	
		3.125 T-NOTE 250815	5,000,000.00	4,880,664.05	
		3.125 T-NOTE 270831	7,300,000.00	6,997,164.02	
		3.125 T-NOTE 281115	8,280,000.00	7,859,369.54	
		3.125 T-NOTE 290831	5,900,000.00	5,560,289.09	
		3.25 T-BOND 420515	6,950,000.00	5,821,710.93	
		3.25 T-NOTE 270630	6,300,000.00	6,073,101.59	
		3.25 T-NOTE 290630	6,170,000.00	5,860,174.43	
		3.375 T-BOND 420815	6,370,000.00	5,421,467.18	
		3.375 T-BOND 440515	3,380,000.00	2,844,877.35	
		3.375 T-BOND 481115	6,920,000.00	5,695,889.85	

		3.375 T-NOTE 330515	16,100,000.00	14,972,685.56	
		3.5 T-BOND 390215	1,360,000.00	1,233,456.24	
		3.5 T-NOTE 250915	5,100,000.00	4,999,394.54	
		3.5 T-NOTE 280131	6,100,000.00	5,908,064.47	
		3.5 T-NOTE 280430	6,900,000.00	6,675,210.97	
		3.5 T-NOTE 300131	5,800,000.00	5,555,878.92	
		3.5 T-NOTE 300430	5,600,000.00	5,355,875.00	
		3.5 T-NOTE 330215	15,100,000.00	14,203,142.59	
		3.625 T-BOND 430815	3,400,000.00	2,982,636.70	
		3.625 T-BOND 440215	3,870,000.00	3,388,139.64	
		3.625 T-BOND 530215	8,690,000.00	7,506,157.21	
		3.625 T-BOND 530515	9,060,000.00	7,831,414.43	
		3.625 T-NOTE 260515	7,000,000.00	6,855,898.42	
		3.625 T-NOTE 280331	6,000,000.00	5,834,179.68	
		3.625 T-NOTE 280531	6,600,000.00	6,414,632.79	
		3.625 T-NOTE 300331	5,500,000.00	5,298,476.59	
		3.75 T-BOND 410815	2,060,000.00	1,873,473.42	
		3.75 T-BOND 431115	3,360,000.00	2,999,259.37	
		3.75 T-NOTE 260415	7,000,000.00	6,873,945.33	
		3.75 T-NOTE 281231	9,280,000.00	9,053,075.02	
		3.75 T-NOTE 300531	5,600,000.00	5,427,296.89	
		3.75 T-NOTE 300630	5,400,000.00	5,232,199.21	
		3.75 T-NOTE 301231	6,660,000.00	6,442,509.36	
		3.875 T-BOND 400815	1,870,000.00	1,743,044.54	
		3.875 T-BOND 430215	6,040,000.00	5,506,191.38	
		3.875 T-BOND 430515	6,200,000.00	5,642,726.57	
		3.875 T-NOTE 250430	4,000,000.00	3,951,328.12	
		3.875 T-NOTE 260115	6,700,000.00	6,598,453.12	
		3.875 T-NOTE 271130	6,900,000.00	6,773,994.13	
		3.875 T-NOTE 271231	7,000,000.00	6,871,757.83	
		3.875 T-NOTE 290930	6,030,000.00	5,898,800.39	
		3.875 T-NOTE 291130	5,100,000.00	4,986,445.33	
		3.875 T-NOTE 291231	5,700,000.00	5,571,527.35	
		3.875 T-NOTE 330815	16,640,000.00	16,087,500.08	
		4 T-BOND 421115	5,870,000.00	5,455,660.53	
		4 T-BOND 521115	9,230,000.00	8,540,273.84	
		4 T-NOTE 251215	7,750,000.00	7,649,340.82	
		4 T-NOTE 260215	8,000,000.00	7,897,500.00	
		4 T-NOTE 270115	7,500,000.00	7,400,683.57	
		4 T-NOTE 280229	6,020,000.00	5,936,049.23	
		4 T-NOTE 280630	6,000,000.00	5,916,679.68	
		4 T-NOTE 290131	10,050,000.00	9,914,953.12	
		4 T-NOTE 291031	5,500,000.00	5,412,558.58	

		4 T-NOTE 300228	5,510,000.00	5,418,202.51	
		4 T-NOTE 300731	5,400,000.00	5,304,445.32	
		4 T-NOTE 310131	6,000,000.00	5,892,187.50	
		4 T-NOTE 340215	6,400,000.00	6,249,000.00	
		4.125 T-BOND 530815	10,020,000.00	9,480,642.23	
		4.125 T-NOTE 260615	7,000,000.00	6,926,718.75	
		4.125 T-NOTE 270215	9,500,000.00	9,406,855.44	
		4.125 T-NOTE 270930	7,440,000.00	7,367,198.40	
		4.125 T-NOTE 271031	6,500,000.00	6,435,507.78	
		4.125 T-NOTE 280731	7,700,000.00	7,631,421.87	
		4.125 T-NOTE 300831	5,360,000.00	5,301,689.04	
		4.125 T-NOTE 321115	16,070,000.00	15,859,395.09	
		4.25 T-BOND 390515	1,770,000.00	1,744,694.52	
		4.25 T-BOND 401115	1,980,000.00	1,928,257.03	
		4.25 T-BOND 540215	3,850,000.00	3,730,289.06	
		4.25 T-NOTE 250531	9,000,000.00	8,923,359.42	
		4.25 T-NOTE 251015	6,000,000.00	5,946,679.68	
		4.25 T-NOTE 251231	8,140,000.00	8,068,139.09	
		4.25 T-NOTE 260131	6,840,000.00	6,780,817.99	
		4.375 T-BOND 380215	1,000,000.00	1,008,222.66	
		4.375 T-BOND 391115	2,270,000.00	2,261,265.80	
		4.375 T-BOND 400515	2,080,000.00	2,065,334.37	
		4.375 T-BOND 410515	1,960,000.00	1,932,360.94	
		4.375 T-BOND 430815	6,360,000.00	6,199,012.50	
		4.375 T-NOTE 260815	5,500,000.00	5,474,433.58	
		4.375 T-NOTE 261215	9,640,000.00	9,606,485.96	
		4.375 T-NOTE 280831	7,000,000.00	7,009,160.13	
		4.375 T-NOTE 281130	8,050,000.00	8,068,552.72	
		4.375 T-NOTE 301130	6,250,000.00	6,270,751.93	
		4.5 T-BOND 360215	1,160,000.00	1,194,966.07	
		4.5 T-BOND 380515	1,330,000.00	1,355,379.09	
		4.5 T-BOND 390815	1,880,000.00	1,903,022.64	
		4.5 T-BOND 440215	2,510,000.00	2,495,685.15	
		4.5 T-NOTE 251115	4,700,000.00	4,677,050.79	
		4.5 T-NOTE 260715	6,500,000.00	6,485,654.30	
		4.5 T-NOTE 331115	18,630,000.00	18,913,816.46	
		4.625 T-BOND 400215	2,100,000.00	2,149,177.73	
		4.625 T-NOTE 250630	5,000,000.00	4,980,859.40	
		4.625 T-NOTE 260315	6,000,000.00	5,993,437.50	
		4.625 T-NOTE 260915	7,500,000.00	7,511,279.32	
		4.625 T-NOTE 261015	6,800,000.00	6,812,882.80	
		4.625 T-NOTE 261115	7,000,000.00	7,016,406.25	

		4.625 T-NOTE 280930	7,050,000.00	7,130,689.42	
		4.625 T-NOTE 300930	5,700,000.00	5,798,636.73	
		4.75 T-BOND 410215	2,010,000.00	2,077,601.94	
		4.75 T-BOND 431115	7,070,000.00	7,239,017.18	
		4.75 T-BOND 531115	10,240,000.00	10,765,599.88	
		4.75 T-NOTE 250731	7,500,000.00	7,484,912.10	
		4.875 T-NOTE 251130	8,400,000.00	8,410,335.94	
		4.875 T-NOTE 281031	8,500,000.00	8,689,589.86	
		4.875 T-NOTE 301031	6,100,000.00	6,293,603.50	
		5 T-BOND 370515	1,020,000.00	1,096,699.16	
		5 T-NOTE 250831	8,500,000.00	8,514,111.36	
		5 T-NOTE 250930	7,600,000.00	7,615,734.35	
		5 T-NOTE 251031	9,500,000.00	9,524,306.60	
		5.25 T-BOND 281115	2,690,000.00	2,791,294.20	
		5.375 T-BOND 310215	1,300,000.00	1,388,917.43	
		6 T-BOND 260215	1,200,000.00	1,229,859.06	
		6.125 T-BOND 271115	1,160,000.00	1,227,303.69	
		6.25 T-BOND 300515	1,150,000.00	1,267,672.38	
アメリカドル合計			1,894,270,000.00	1,692,387,646.28 (251,471,880,360)	
カナダドル	国債証券	0.25 CAN GOVT 260301	2,200,000.00	2,042,008.56	
		0.5 CAN GOVT 250901	2,900,000.00	2,744,510.26	
		0.5 CAN GOVT 301201	4,500,000.00	3,696,825.96	
		1 CAN GOVT 260901	2,500,000.00	2,328,247.70	
		1 CAN GOVT 270601	1,930,000.00	1,773,636.63	
		1.25 CAN GOVT 270301	2,500,000.00	2,321,829.32	
		1.25 CAN GOVT 300601	4,410,000.00	3,856,754.47	
		1.5 CAN GOVT 250401	1,000,000.00	968,732.64	
		1.5 CAN GOVT 260601	4,070,000.00	3,853,386.62	
		1.5 CAN GOVT 310601	5,900,000.00	5,142,085.29	
		1.5 CAN GOVT 311201	4,270,000.00	3,686,316.49	
		1.75 CAN GOVT 531201	4,900,000.00	3,393,193.30	
		2 CAN GOVT 280601	2,670,000.00	2,504,962.73	
		2 CAN GOVT 320601	3,750,000.00	3,341,993.96	
		2 CAN GOVT 511201	6,060,000.00	4,518,691.78	
		2.25 CAN GOVT 250601	4,360,000.00	4,246,451.51	
		2.25 CAN GOVT 290601	2,210,000.00	2,080,220.42	
		2.25 CAN GOVT 291201	1,000,000.00	937,264.41	
		2.5 CAN GOVT 321201	3,500,000.00	3,230,102.92	
		2.75 CAN GOVT 270901	2,000,000.00	1,936,984.40	
		2.75 CAN GOVT 330601	3,000,000.00	2,817,628.38	
		2.75 CAN GOVT 481201	1,680,000.00	1,488,213.16	
		2.75 CAN GOVT 551201	2,040,000.00	1,786,198.36	

		2.75 CANADA GOVER 641201	1,250,000.00	1,084,216.88	
		3 CAN GOVT 251001	3,000,000.00	2,939,117.22	
		3 CAN GOVT 340601	2,140,000.00	2,045,089.47	
		3.25 CAN GOVT 280901	2,600,000.00	2,559,224.12	
		3.25 CAN GOVT 331201	3,170,000.00	3,099,432.97	
		3.5 CAN GOVT 280301	2,000,000.00	1,987,507.96	
		3.5 CAN GOVT 451201	1,650,000.00	1,656,554.69	
		3.75 CAN GOVT 250501	3,500,000.00	3,468,914.54	
		4 CAN GOVT 290301	2,950,000.00	3,003,454.38	
		4 CAN GOVT 410601	1,200,000.00	1,276,610.59	
		4.5 CAN GOVT 251101	2,540,000.00	2,546,053.40	
		4.5 CAN GOVT 260201	5,200,000.00	5,226,101.08	
		5 CAN GOVT 370601	830,000.00	958,059.15	
		5.75 CAN GOVT 290601	950,000.00	1,050,041.53	
		5.75 CAN GOVT 330601	1,430,000.00	1,672,983.15	
カナダドル合計			107,760,000.00	99,269,600.40 (10,897,816,731)	
オーストラリアドル	国債証券	0.25 AUST GOVT 251121	5,450,000.00	5,138,397.55	
		0.5 AUST GOVT 260921	4,100,000.00	3,790,252.87	
		1 AUST GOVT 301221	3,010,000.00	2,498,999.70	
		1 AUST GOVT 311121	5,310,000.00	4,278,740.32	
		1.25 AUST GOVT 320521	4,530,000.00	3,669,557.71	
		1.5 AUST GOVT 310621	3,740,000.00	3,172,719.23	
		1.75 AUST GOVT 321121	3,980,000.00	3,321,903.77	
		1.75 AUST GOVT 510621	3,070,000.00	1,765,758.57	
		2.25 AUST GOVT 280521	2,900,000.00	2,737,724.09	
		2.5 AUST GOVT 300521	3,940,000.00	3,654,833.28	
		2.75 AUST GOVT 271121	2,490,000.00	2,410,040.47	
		2.75 AUST GOVT 281121	3,040,000.00	2,913,626.62	
		2.75 AUST GOVT 291121	2,980,000.00	2,822,442.15	
		2.75 AUST GOVT 350621	1,520,000.00	1,335,445.74	
		2.75 AUST GOVT 410521	2,170,000.00	1,751,878.02	
		3 AUST GOVT 331121	4,100,000.00	3,756,291.30	
		3 AUST GOVT 470321	2,020,000.00	1,602,692.15	
		3.25 AUST GOVT 250421	1,100,000.00	1,091,298.79	
		3.25 AUST GOVT 290421	2,660,000.00	2,597,928.95	
		3.25 AUST GOVT 390621	2,130,000.00	1,887,907.43	
		3.5 AUST GOVT 341221	2,300,000.00	2,183,579.10	
		3.75 AUST GOVT 340521	3,700,000.00	3,603,228.08	
		3.75 AUST GOVT 370421	3,150,000.00	3,015,372.37	
		4.25 AUST GOVT 260421	2,490,000.00	2,516,338.47	
		4.5 AUST GOVT 330421	3,900,000.00	4,037,271.03	

		4.75 AUST GOVT 270421	3,050,000.00	3,144,313.93	
		4.75 AUST GOVT 540621	1,270,000.00	1,336,418.71	
オーストラリアドル合計			84,100,000.00	76,034,960.40 (7,422,532,834)	
イギリスポンド	国債証券	0.125 GILT 260130	2,600,000.00	2,407,002.00	
		0.125 GILT 280131	2,300,000.00	1,980,783.00	
		0.25 GILT 310731	4,460,000.00	3,414,103.24	
		0.375 GILT 261022	3,750,000.00	3,397,312.50	
		0.375 GILT 301022	2,390,000.00	1,901,283.24	
		0.5 GILT 290131	4,900,000.00	4,148,928.00	
		0.5 GILT 611022	3,700,000.00	1,121,840.00	
		0.625 GILT 250607	2,880,000.00	2,745,360.00	
		0.625 GILT 350731	4,030,000.00	2,753,296.00	
		0.625 GILT 501022	2,890,000.00	1,177,386.00	
		0.875 GILT 291022	2,320,000.00	1,966,292.80	
		0.875 GILT 330731	5,140,000.00	3,880,095.53	
		0.875 GILT 460131	2,930,000.00	1,468,369.50	
		1 GILT 320131	5,880,000.00	4,705,317.12	
		1.125 GILT 390131	3,600,000.00	2,335,410.72	
		1.125 GILT 731022	1,500,000.00	557,502.00	
		1.25 GILT 270722	2,100,000.00	1,915,330.20	
		1.25 GILT 411022	4,250,000.00	2,618,000.00	
		1.25 GILT 510731	4,180,000.00	2,066,592.00	
		1.5 GILT 260722	2,490,000.00	2,341,430.66	
		1.5 GILT 470722	3,160,000.00	1,799,304.00	
		1.5 GILT 530731	2,950,000.00	1,523,970.00	
		1.625 GILT 281022	3,470,000.00	3,134,104.00	
		1.625 GILT 541022	2,470,000.00	1,309,841.00	
		1.625 GILT 711022	2,530,000.00	1,186,064.00	
		1.75 GILT 370907	3,340,000.00	2,482,288.00	
		1.75 GILT 490122	1,780,000.00	1,054,205.00	
		1.75 GILT 570722	3,230,000.00	1,739,355.00	
		2 GILT 250907	2,100,000.00	2,024,408.40	
		2.5 GILT 650722	2,480,000.00	1,596,624.00	
		3.25 GILT 330131	5,100,000.00	4,809,185.76	
		3.25 GILT 440122	3,440,000.00	2,882,376.00	
		3.5 GILT 251022	6,150,000.00	6,048,537.30	
		3.5 GILT 450122	3,190,000.00	2,760,354.85	
		3.5 GILT 680722	2,470,000.00	2,052,570.00	
		3.75 GILT 270307	2,000,000.00	1,971,826.10	
		3.75 GILT 380129	3,350,000.00	3,152,685.00	
		3.75 GILT 520722	2,110,000.00	1,859,965.00	

		3.75 GILT 531022	4,540,000.00	3,981,489.20	
		4 GILT 311022	700,000.00	700,644.56	
		4 GILT 600122	1,980,000.00	1,824,823.44	
		4 GILT 631022	2,030,000.00	1,865,164.00	
		4.125 GILT 270129	4,900,000.00	4,882,507.00	
		4.25 GILT 271207	2,450,000.00	2,464,651.00	
		4.25 GILT 320607	3,370,000.00	3,441,417.04	
		4.25 GILT 360307	2,910,000.00	2,928,067.60	
		4.25 GILT 390907	2,020,000.00	1,994,144.00	
		4.25 GILT 401207	2,420,000.00	2,376,198.00	
		4.25 GILT 461207	2,680,000.00	2,581,268.80	
		4.25 GILT 491207	1,990,000.00	1,910,798.00	
		4.25 GILT 551207	2,770,000.00	2,660,308.00	
		4.375 GILT 540731	730,000.00	712,918.00	
		4.5 GILT 280607	4,000,000.00	4,062,840.00	
		4.5 GILT 340907	1,990,000.00	2,055,461.05	
		4.5 GILT 421207	3,190,000.00	3,210,342.63	
		4.625 GILT 340131	2,770,000.00	2,891,990.80	
		4.75 GILT 301207	3,650,000.00	3,823,656.05	
		4.75 GILT 381207	2,310,000.00	2,413,853.44	
		4.75 GILT 431022	1,600,000.00	1,654,880.00	
		6 GILT 281207	1,890,000.00	2,054,453.05	
イギリスポンド合計			180,500,000.00	148,781,173.58 (28,164,276,158)	
シンガポールドル	国債証券	1.25 SINGAPORGOVT 261101	700,000.00	666,190.00	
		1.625 SINGAPORGOV 310701	1,050,000.00	952,350.00	
		1.875 SINGAPORGOV 500301	700,000.00	559,300.00	
		1.875 SINGAPORGOV 511001	950,000.00	754,461.50	
		2.125 SINGAPORGOV 260601	1,530,000.00	1,492,515.00	
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	1,300,000.00	1,196,390.00	
		2.375 SINGAPORGOV 250601	1,560,000.00	1,539,096.00	
		2.375 SINGAPORGOV 390701	780,000.00	718,263.00	
		2.625 SINGAPORGOV 280501	800,000.00	787,040.00	
		2.625 SINGAPORGOV 320801	700,000.00	677,950.00	
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	980,000.00	943,392.10	
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	1,140,000.00	1,092,120.00	
		2.875 SINGAPORGOV 270901	1,000,000.00	994,000.00	
		2.875 SINGAPORGOV 280801	1,000,000.00	995,390.00	
		2.875 SINGAPORGOV 290701	1,760,000.00	1,746,272.00	
		2.875SINGAPORGOVT 300901	1,340,000.00	1,326,198.00	
		3 SINGAPORGOVT 720801	910,000.00	911,820.00	
		3.375 SINGAPORGOV 330901	1,280,000.00	1,315,820.80	

		3.5 SINGAPORGOVT 270301	1,000,000.00	1,011,100.00	
シンガポールドル合計			20,480,000.00	19,679,668.40 (2,187,985,532)	
マレーシアリンギット	国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	4,080,000.00	3,797,221.23	
		3.502MALAYSIAGOVT 270531	3,000,000.00	3,003,242.40	
		3.582 MALAYSIAGOV 320715	2,370,000.00	2,323,646.30	
		3.733 MALAYSIAGO 280615	2,800,000.00	2,813,940.36	
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	3,980,000.00	3,858,784.19	
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	3,410,000.00	3,393,384.91	
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	2,400,000.00	2,394,995.59	
		3.882 MALAYSIAGOV 250314	1,010,000.00	1,015,759.12	
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	3,600,000.00	3,642,000.48	
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	5,100,000.00	5,155,554.30	
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	5,640,000.00	5,714,392.72	
		3.9 MALAYSIAGOVT 261130	2,900,000.00	2,932,723.28	
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	2,960,000.00	2,990,369.29	
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	4,540,000.00	4,575,506.88	
		4.065 MALAYSIAGOV 500615	5,250,000.00	5,172,964.86	
		4.232MALAYSIAGOVT 310630	2,550,000.00	2,624,100.19	
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	2,150,000.00	2,216,904.34	
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	1,940,000.00	1,977,762.10	
		4.457 MALAYSIAGOV 530331	1,900,000.00	1,986,360.32	
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	3,640,000.00	3,787,744.68	
		4.504 MALAYSIAGOV 290430	1,500,000.00	1,560,295.80	
		4.642 MALAYSIAGOV 331107	2,800,000.00	2,973,647.60	
		4.696 MALAYSIAGOV 421015	3,900,000.00	4,218,674.07	
		4.736 MALAYSIAGOV 460315	1,650,000.00	1,791,898.18	
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	4,440,000.00	4,800,166.14	
		4.893 MALAYSIAGOV 380608	3,360,000.00	3,692,616.48	
		4.921 MALAYSIAGOV 480706	2,020,000.00	2,252,946.80	
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	1,190,000.00	1,323,060.20	
マレーシアリンギット合計			86,080,000.00	87,990,662.81 (2,778,701,136)	
ニュージーランドドル	国債証券	0.25 NZ GOVT 280515	2,000,000.00	1,684,341.72	
		1.75 NZ GOVT 410515	600,000.00	381,917.17	
		2 NZ GOVT 320515	2,300,000.00	1,902,895.82	
		2.75 NZ GOVT 250415	1,400,000.00	1,363,433.91	
		2.75 NZ GOVT 370415	1,450,000.00	1,162,382.82	
		2.75 NZ GOVT 510515	1,180,000.00	802,306.74	
		3 NZ GOVT 290420	1,700,000.00	1,589,727.78	
		3.5 NZ GOVT 330414	1,900,000.00	1,746,041.59	
		4.25 NZ GOVT 340515	620,000.00	599,717.38	

		4.5 NZ GOVT 270415	1,800,000.00	1,798,297.27	
		4.5 NZ GOVT 300515	1,000,000.00	1,002,074.00	
		5 NZ GOVT 540515	620,000.00	628,064.46	
ニュージーランドドル合計			16,570,000.00	14,661,200.66 (1,331,530,243)	
スウェーデンクローネ	国債証券	0.125 SWD GOVT 310512	9,450,000.00	8,087,357.25	
		0.75 SWD GOVT 280512	8,000,000.00	7,479,905.12	
		0.75 SWD GOVT 291112	12,200,000.00	11,208,380.09	
		1 SWD GOVT 261112	11,960,000.00	11,459,328.20	
		1.75 SWD GOVT 331111	11,500,000.00	10,910,731.72	
		2.25 SWD GOVT 320601	6,750,000.00	6,707,100.03	
		2.5 SWD GOVT 250512	8,840,000.00	8,768,269.23	
		3.5 SWD GOVT 390330	6,470,000.00	7,246,011.80	
スウェーデンクローネ合計			75,170,000.00	71,867,083.44 (1,031,292,647)	
ノルウェークローネ	国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	4,700,000.00	3,998,515.60	
		1.375 NORWE GOVT 300819	8,770,000.00	7,708,359.92	
		1.5 NORWE GOVT 260219	6,040,000.00	5,784,930.80	
		1.75 NORWE GOVT 250313	10,200,000.00	9,956,730.00	
		1.75 NORWE GOVT 270217	5,120,000.00	4,857,963.52	
		1.75 NORWE GOVT 290906	4,600,000.00	4,200,950.00	
		2 NORWE GOVT 280426	6,900,000.00	6,493,435.44	
		2.125 NORWE GOVT 320518	10,500,000.00	9,427,257.00	
		3 NORWE GOVT 330815	8,700,000.00	8,295,909.36	
		3.5 NORWE GOVT 421006	4,000,000.00	4,105,904.00	
ノルウェークローネ合計			69,530,000.00	64,829,955.64 (909,564,277)	
デンマーククローネ	国債証券	0 DMK GOVT 311115	14,550,000.00	12,172,611.33	
		0.25 DMK GOVT 521115	9,730,000.00	5,260,610.12	
		0.5 DMK GOVT 271115	8,100,000.00	7,547,818.14	
		0.5 DMK GOVT 291115	10,550,000.00	9,509,695.09	
		1.75 DMK GOVT 251115	7,490,000.00	7,354,618.25	
		2.25 DMK GOVT 331115	3,500,000.00	3,438,301.61	
		4.5 DMK GOVT 391115	15,650,000.00	19,474,741.06	
デンマーククローネ合計			69,570,000.00	64,758,395.60 (1,403,962,016)	
メキシコペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 361120	12,350,000.00	13,084,948.50	
		5 MEXICAN BONOS 250306	34,000,000.00	32,362,900.00	
		5.5 MEXICAN BONOS 270304	52,000,000.00	46,676,760.00	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	65,500,000.00	60,607,777.49	
		7 MEXICAN BONOS 260903	20,000,000.00	18,780,200.00	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	48,750,000.00	46,107,750.00	
		7.5 MEXICAN BONOS 330526	44,840,000.00	40,188,298.40	

		7.75 MEXICAN BONO 310529	68,050,000.00	62,929,237.50	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	13,400,000.00	12,057,856.00	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	49,690,000.00	42,614,640.90	
		8 MEXICAN BONOS 350524	5,000,000.00	4,579,300.00	
		8 MEXICAN BONOS 471107	39,100,000.00	34,086,989.00	
		8 MEXICAN BONOS 530731	38,270,000.00	33,056,095.20	
		8.5 MEXICAN BONOS 290301	13,420,000.00	13,031,356.80	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	55,650,000.00	54,106,825.50	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	39,700,000.00	37,231,454.00	
メキシコペソ合計			599,720,000.00	551,502,389.29 (4,906,771,907)	
イスラエルシェケル	国債証券	0.5 ISRAEL FIXED 260227	5,800,000.00	5,436,630.00	
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	3,370,000.00	2,853,547.50	
		1.3 ISRAEL FIXED 320430	4,800,000.00	3,895,440.00	
		1.5 ISRAEL FIXED 370531	4,900,000.00	3,483,165.00	
		2 ISRAEL FIXED BO 270331	7,000,000.00	6,752,550.00	
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	3,080,000.00	2,889,502.00	
		2.8 ISRAEL FIXED 521129	800,000.00	554,200.00	
		3.75 ISRAEL FIXED 290228	4,600,000.00	4,549,170.00	
		3.75 ISRAEL FIXED 470331	4,680,000.00	4,177,134.00	
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	3,130,000.00	3,466,318.50	
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	5,000,000.00	5,405,500.00	
イスラエルシェケル合計			47,160,000.00	43,463,157.00 (1,766,560,016)	
ポーランドズロチ	国債証券	0.25 POLAND 261025	3,000,000.00	2,651,091.00	
		0.75 POLAND 250425	3,500,000.00	3,341,898.00	
		1.25 POLAND 301025	9,190,000.00	7,172,969.61	
		1.75 POLAND 320425	9,900,000.00	7,575,084.00	
		2.5 POLAND 260725	7,840,000.00	7,395,675.84	
		2.5 POLAND 270725	6,110,000.00	5,617,986.14	
		2.75 POLAND 280425	5,760,000.00	5,246,415.36	
		2.75 POLAND 291025	7,900,000.00	6,954,022.40	
		3.25 POLAND 250725	8,700,000.00	8,489,199.00	
		3.75 POLAND 270525	4,000,000.00	3,837,824.00	
		5.75 POLAND 290425	5,600,000.00	5,709,119.36	
		6 POLAND 331025	4,720,000.00	4,907,209.36	
		7.5 POLAND 280725	6,000,000.00	6,505,380.00	
ポーランドズロチ合計			82,220,000.00	75,403,874.07 (2,835,080,099)	
中国元	国債証券	1.99 CHINA GOVT 250409	35,000,000.00	35,014,280.00	
		2 CHINA GOVT 250615	42,000,000.00	41,974,721.46	
		2.18 CHINA GOVT 250825	34,000,000.00	34,065,518.00	
		2.18 CHINA GOVT 260815	39,000,000.00	39,021,762.00	

		2.22 CHINA GOVT 250925	50,000,000.00	50,111,150.00	
		2.24 CHINA GOVT 250525	18,000,000.00	18,047,952.00	
		2.28 CHINA GOVT 251125	34,000,000.00	34,116,552.00	
		2.3 CHINA GOVT 260515	30,000,000.00	30,093,378.00	
		2.33 CHINA GOVT 251215	45,000,000.00	45,202,860.00	
		2.35 CHINA GOVT 250315	22,000,000.00	22,099,946.00	
		2.37 CHINA GOVT 270120	28,000,000.00	28,107,679.60	
		2.37 CHINA GOVT 290115	20,000,000.00	20,099,120.00	
		2.39 CHINA GOVT 261115	38,000,000.00	38,228,760.00	
		2.4 CHINA GOVT 280715	39,000,000.00	39,220,896.00	
		2.44 CHINA GOVT 271015	35,000,000.00	35,243,320.00	
		2.46 CHINA GOVT 260215	37,000,000.00	37,250,490.00	
		2.48 CHINA GOVT 270415	28,000,000.00	28,231,168.00	
		2.48 CHINA GOVT 280925	12,000,000.00	12,101,568.00	
		2.5 CHINA GOVT 270725	33,000,000.00	33,278,487.00	
		2.52 CHINA GOVT 330825	37,000,000.00	37,352,258.50	
		2.54 CHINA GOVT 301225	49,000,000.00	49,578,984.00	
		2.55 CHINA GOVT 281015	50,000,000.00	50,632,550.00	
		2.6 CHINA GOVT 300915	39,000,000.00	39,575,835.00	
		2.6 CHINA GOVT 320901	25,000,000.00	25,343,480.00	
		2.62 CHINA GOVT 280415	33,000,000.00	33,468,237.00	
		2.62 CHINA GOVT 290925	27,000,000.00	27,407,268.00	
		2.62 CHINA GOVT 300625	34,000,000.00	34,496,604.00	
		2.64 CHINA GOVT 280115	41,000,000.00	41,570,392.00	
		2.67 CHINA GOVT 330525	35,000,000.00	35,679,875.00	
		2.67 CHINA GOVT 331125	43,000,000.00	44,230,156.90	
		2.68 CHINA GOVT 300521	45,000,000.00	45,810,990.00	
		2.69 CHINA GOVT 260812	34,000,000.00	34,428,162.00	
		2.69 CHINA GOVT 320815	33,000,000.00	33,681,555.60	
		2.74 CHINA GOVT 260804	15,000,000.00	15,219,450.00	
		2.75 CHINA GOVT 290615	30,000,000.00	30,644,670.00	
		2.75 CHINA GOVT 320217	30,000,000.00	30,731,925.00	
		2.76 CHINA GOVT 320515	25,000,000.00	25,635,460.00	
		2.79 CHINA GOVT 291215	31,000,000.00	31,758,105.00	
		2.8 CHINA GOVT 290324	27,000,000.00	27,647,082.00	
		2.8 CHINA GOVT 300325	35,000,000.00	35,866,040.00	
		2.8 CHINA GOVT 321115	29,000,000.00	29,857,762.00	
		2.85 CHINA GOVT 270604	32,000,000.00	32,659,392.00	
		2.88 CHINA GOVT 330225	29,000,000.00	30,092,137.10	
		2.89 CHINA GOVT 311118	20,000,000.00	20,683,412.00	
		2.9 CHINA GOVT 260505	24,000,000.00	24,387,724.80	
		2.91 CHINA GOVT 281014	32,000,000.00	32,908,384.00	
			39,000,000.00	39,656,272.50	

		2.99 CHINA GOVT 251015			
		3 CHINA GOVT 531015	17,000,000.00	18,638,851.00	
		3.01 CHINA GOVT 280513	39,000,000.00	40,195,974.00	
		3.02 CHINA GOVT 251022	36,000,000.00	36,584,820.00	
		3.02 CHINA GOVT 310527	38,000,000.00	39,626,700.20	
		3.03 CHINA GOVT 260311	28,000,000.00	28,532,224.00	
		3.12 CHINA GOVT 261205	37,000,000.00	38,045,768.00	
		3.12 CHINA GOVT 521025	15,000,000.00	16,382,973.00	
		3.13 CHINA GOVT 291121	30,000,000.00	31,352,850.00	
		3.19 CHINA GOVT 530415	17,000,000.00	19,149,085.60	
		3.22 CHINA GOVT 251206	18,000,000.00	18,395,442.00	
		3.25 CHINA GOVT 260606	28,000,000.00	28,792,232.00	
		3.25 CHINA GOVT 281122	25,000,000.00	26,192,200.00	
		3.27 CHINA GOVT 301119	35,000,000.00	37,100,455.00	
		3.28 CHINA GOVT 271203	24,000,000.00	25,002,768.00	
		3.29 CHINA GOVT 290523	29,000,000.00	30,513,742.00	
		3.32 CHINA GOVT 520415	21,000,000.00	23,747,606.40	
		3.39 CHINA GOVT 500316	33,000,000.00	37,490,428.80	
		3.52 CHINA GOVT 270504	19,000,000.00	19,893,988.00	
		3.53 CHINA GOVT 511018	17,000,000.00	19,910,105.90	
		3.54 CHINA GOVT 280816	13,000,000.00	13,798,954.00	
		3.59 CHINA GOVT 270803	7,000,000.00	7,375,018.00	
		3.6 CHINA GOVT 250906	8,000,000.00	8,217,848.00	
		3.61 CHINA GOVT 250607	10,000,000.00	10,242,820.00	
		3.69 CHINA GOVT 280517	15,000,000.00	16,047,105.00	
		3.72 CHINA GOVT 510412	21,000,000.00	25,315,208.10	
		3.77 CHINA GOVT 250308	11,000,000.00	11,231,682.00	
		3.81 CHINA GOVT 500914	34,000,000.00	41,409,327.60	
		3.86 CHINA GOVT 490722	29,000,000.00	35,361,219.60	
		4.08 CHINA GOVT 481022	25,000,000.00	31,472,295.00	
中国元合計			2,221,000,000.00	2,298,533,463.66 (47,445,868,050)	
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 250420	800,000.00	771,884.26	
		0 AUSTRIA GOVT 281020	1,790,000.00	1,582,612.39	
		0 AUSTRIA GOVT 300220	2,150,000.00	1,833,384.55	
		0 AUSTRIA GOVT 310220	2,720,000.00	2,250,710.24	
		0 AUSTRIA GOVT 401020	810,000.00	491,273.10	
		0 BEL GOVT 271022	1,800,000.00	1,634,128.20	
		0 BEL GOVT 311022	2,300,000.00	1,868,310.70	
		0 BUND 260815	5,930,000.00	5,558,605.58	
		0 BUND 271115	3,100,000.00	2,830,169.80	
		0 BUND 281115	3,430,000.00	3,068,008.09	
		0 BUND 290815	4,550,000.00	4,005,738.10	

		0 BUND 300215	4,820,000.00	4,197,357.22	
		0 BUND 300815	4,960,000.00	4,271,710.72	
		0 BUND 300815	1,550,000.00	1,336,464.25	
		0 BUND 310215	4,480,000.00	3,815,212.80	
		0 BUND 310815	5,400,000.00	4,548,015.00	
		0 BUND 310815	1,900,000.00	1,600,963.63	
		0 BUND 320215	4,690,000.00	3,900,973.16	
		0 BUND 350515	3,630,000.00	2,763,980.01	
		0 BUND 360515	3,800,000.00	2,811,042.09	
		0 BUND 500815	6,220,000.00	3,209,432.92	
		0 BUND 500815	1,560,000.00	808,098.72	
		0 BUND 520815	5,150,000.00	2,533,331.35	
		0 FINNISH GOVT 300915	750,000.00	629,538.00	
		0 IRISH GOVT 311018	1,350,000.00	1,108,964.25	
		0 ITALY GOVT 260401	3,300,000.00	3,092,760.00	
		0 ITALY GOVT 260801	5,000,000.00	4,641,590.00	
		0 NETH GOVT 260115	2,200,000.00	2,086,301.80	
		0 NETH GOVT 270115	1,950,000.00	1,809,635.10	
		0 NETH GOVT 290115	1,300,000.00	1,148,472.00	
		0 NETH GOVT 300715	2,650,000.00	2,253,933.65	
		0 NETH GOVT 310715	2,220,000.00	1,839,542.74	
		0 NETH GOVT 380115	1,540,000.00	1,050,018.20	
		0 NETH GOVT 520115	2,830,000.00	1,362,025.51	
		0 O.A.T 250325	3,880,000.00	3,747,909.28	
		0 O.A.T 260225	6,600,000.00	6,234,815.40	
		0 O.A.T 270225	6,130,000.00	5,653,257.64	
		0 O.A.T 291125	7,180,000.00	6,176,580.64	
		0 O.A.T 301125	8,840,000.00	7,397,975.00	
		0 O.A.T 311125	8,400,000.00	6,827,839.20	
		0 O.A.T 320525	6,030,000.00	4,825,983.87	
		0 OBL 250411	2,800,000.00	2,703,271.48	
		0 OBL 251010	4,000,000.00	3,819,060.00	
		0 OBL 251010	1,000,000.00	955,656.98	
		0 OBL 260410	6,910,000.00	6,524,460.69	
		0 OBL 261009	2,900,000.00	2,709,365.60	
		0 OBL 270416	3,050,000.00	2,818,709.35	
		0 SPAIN GOVT 250531	2,500,000.00	2,402,087.50	
		0 SPAIN GOVT 260131	3,000,000.00	2,832,909.00	
		0 SPAIN GOVT 270131	8,500,000.00	7,814,475.00	
		0 SPAIN GOVT 280131	3,800,000.00	3,401,304.00	
		0.1 BEL GOVT 300622	2,320,000.00	1,976,466.00	
		0.1 SPAIN GOVT 310430	4,360,000.00	3,569,710.76	
			1,070,000.00	881,471.35	

		0.125 FINNISH GOV 310915			
		0.125 FINNISH GOV 360415	1,120,000.00	798,369.60	
		0.125 FINNISH GOV 520415	750,000.00	349,624.72	
		0.2 IRISH GOVT 270515	500,000.00	462,896.00	
		0.2 IRISH GOVT 301018	1,220,000.00	1,045,703.15	
		0.25 AUSTRIA GOVT 361020	1,050,000.00	750,739.50	
		0.25 BUND 280815	4,170,000.00	3,793,336.41	
		0.25 BUND 290215	4,850,000.00	4,370,708.45	
		0.25 FINNISH GOVT 400915	540,000.00	345,330.00	
		0.25 ITALY GOVT 280315	2,700,000.00	2,411,985.60	
		0.25 NETH GOVT 250715	1,930,000.00	1,857,947.31	
		0.25 NETH GOVT 290715	2,950,000.00	2,612,276.62	
		0.25 O.A.T 261125	7,360,000.00	6,874,990.72	
		0.35 BEL GOVT 320622	2,940,000.00	2,411,746.68	
		0.35 IRISH GOVT 321018	800,000.00	658,861.60	
		0.4 BEL GOVT 400622	1,300,000.00	840,698.30	
		0.4 IRISH GOVT 350515	1,020,000.00	786,377.16	
		0.45 ITALY GOVT 290215	2,300,000.00	2,017,571.50	
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	2,100,000.00	1,959,430.20	
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	2,050,000.00	1,842,181.25	
		0.5 BUND 260215	6,660,000.00	6,368,691.60	
		0.5 BUND 270815	5,120,000.00	4,783,662.08	
		0.5 BUND 280215	4,280,000.00	3,968,493.04	
		0.5 FINNISH GOVT 260415	1,670,000.00	1,589,601.19	
		0.5 FINNISH GOVT 270915	700,000.00	647,680.60	
		0.5 FINNISH GOVT 280915	1,480,000.00	1,343,424.12	
		0.5 FINNISH GOVT 290915	1,350,000.00	1,199,346.75	
		0.5 FINNISH GOVT 430415	780,000.00	493,116.00	
		0.5 ITALY GOVT 260201	2,450,000.00	2,329,190.50	
		0.5 ITALY GOVT 280715	2,400,000.00	2,147,443.20	
		0.5 NETH GOVT 260715	3,970,000.00	3,768,448.26	
		0.5 NETH GOVT 320715	2,300,000.00	1,938,751.76	
		0.5 NETH GOVT 400115	2,630,000.00	1,867,363.12	
		0.5 O.A.T 250525	6,490,000.00	6,278,572.02	
		0.5 O.A.T 260525	10,240,000.00	9,723,883.52	
		0.5 O.A.T 290525	9,030,000.00	8,084,685.42	
		0.5 O.A.T 400525	3,990,000.00	2,663,576.37	
		0.5 O.A.T 440625	3,390,000.00	2,038,005.27	
		0.5 O.A.T 720525	2,100,000.00	826,503.90	
		0.5 SPAIN GOVT 300430	4,580,000.00	3,968,331.84	
		0.5 SPAIN GOVT 311031	3,190,000.00	2,652,670.02	
		0.55 IRISH GOVT 410422	600,000.00	404,580.00	
		0.6 ITALY GOVT 310801	3,100,000.00	2,544,557.50	

		0.6 SPAIN GOVT 291031	3,680,000.00	3,246,841.92	
		0.65 BEL GOVT 710622	1,090,000.00	464,945.79	
		0.7 AUSTRIA GOVT 710420	680,000.00	309,434.00	
		0.7 SPAIN GOVT 320430	3,800,000.00	3,167,740.80	
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	2,480,000.00	2,354,308.64	
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	2,940,000.00	2,726,529.54	
		0.75 AUSTRIA GOVT 510320	1,570,000.00	916,171.93	
		0.75 FINNISH GOVT 310415	1,050,000.00	916,751.85	
		0.75 NETH GOVT 270715	2,670,000.00	2,511,385.98	
		0.75 NETH GOVT 280715	3,020,000.00	2,795,463.00	
		0.75 O.A.T 280225	7,400,000.00	6,860,540.00	
		0.75 O.A.T 280525	9,750,000.00	9,003,842.25	
		0.75 O.A.T 281125	9,060,000.00	8,292,391.50	
		0.75 O.A.T 520525	5,560,000.00	3,018,385.00	
		0.75 O.A.T 530525	4,990,000.00	2,649,133.61	
		0.8 BEL GOVT 250622	2,970,000.00	2,878,417.08	
		0.8 BEL GOVT 270622	2,880,000.00	2,705,993.28	
		0.8 BEL GOVT 280622	2,250,000.00	2,082,174.75	
		0.8 SPAIN GOVT 270730	3,350,000.00	3,124,042.50	
		0.8 SPAIN GOVT 290730	5,430,000.00	4,869,900.93	
		0.85 AUSTRIA GOVT 200630	650,000.00	299,861.25	
		0.85 ITALY GOVT 270115	3,060,000.00	2,874,411.00	
		0.85 SPAIN GOVT 370730	2,470,000.00	1,791,728.12	
		0.875 FINNISH GOV 250915	630,000.00	609,774.48	
		0.9 AUSTRIA GOVT 320220	2,120,000.00	1,834,656.48	
		0.9 BEL GOVT 290622	3,090,000.00	2,824,612.26	
		0.9 IRISH GOVT 280515	1,640,000.00	1,531,545.16	
		0.9 ITALY GOVT 310401	4,230,000.00	3,586,363.20	
		0.95 ITALY GOVT 270915	4,000,000.00	3,718,872.60	
		0.95 ITALY GOVT 300801	2,940,000.00	2,544,937.50	
		0.95 ITALY GOVT 311201	2,730,000.00	2,280,232.50	
		0.95 ITALY GOVT 320601	3,600,000.00	2,964,880.80	
		0.95 ITALY GOVT 370301	2,560,000.00	1,816,860.16	
		1 BEL GOVT 260622	2,760,000.00	2,646,867.60	
		1 BEL GOVT 310622	2,850,000.00	2,522,731.65	
		1 BUND 250815	5,580,000.00	5,416,676.19	
		1 BUND 380515	3,610,000.00	2,942,103.07	
		1 IRISH GOVT 260515	1,850,000.00	1,778,960.00	
		1 O.A.T 251125	6,580,000.00	6,358,181.62	
		1 O.A.T 270525	7,540,000.00	7,136,534.60	
		1 SPAIN GOVT 420730	2,070,000.00	1,356,011.46	
		1 SPAIN GOVT 501031	3,650,000.00	2,003,616.40	

		1.1 IRISH GOVT 290515	1,610,000.00	1,494,402.00	
		1.1 ITALY GOVT 270401	3,300,000.00	3,109,415.10	
		1.125 FINNISH GOV 340415	730,000.00	618,634.85	
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	2,710,000.00	2,631,236.56	
		1.2 ITALY GOVT 250815	2,100,000.00	2,037,630.00	
		1.2 SPAIN GOVT 401031	3,030,000.00	2,133,835.08	
		1.25 BEL GOVT 330422	1,770,000.00	1,550,292.99	
		1.25 BUND 480815	5,990,000.00	4,567,303.12	
		1.25 ITALY GOVT 261201	2,680,000.00	2,552,968.00	
		1.25 O.A.T 340525	7,490,000.00	6,417,891.35	
		1.25 O.A.T 360525	7,150,000.00	5,887,538.80	
		1.25 O.A.T 380525	2,880,000.00	2,273,826.24	
		1.25 SPAIN GOVT 301031	4,030,000.00	3,622,155.94	
		1.3 IRISH GOVT 330515	860,000.00	762,630.80	
		1.3 OBL 271015	5,750,000.00	5,513,571.50	
		1.3 OBL 271015	800,000.00	768,012.80	
		1.3 SPAIN GOVT 261031	4,750,000.00	4,551,397.75	
		1.35 IRISH GOVT 310318	1,070,000.00	985,181.10	
		1.35 ITALY GOVT 300401	3,610,000.00	3,233,343.43	
		1.375 FINNISH GOV 270415	800,000.00	766,520.00	
		1.375 FINNISH GOV 470415	840,000.00	610,831.20	
		1.4 BEL GOVT 530622	1,720,000.00	1,101,092.40	
		1.4 SPAIN GOVT 280430	3,740,000.00	3,526,068.26	
		1.4 SPAIN GOVT 280730	4,240,000.00	3,987,109.44	
		1.45 BEL GOVT 370622	1,220,000.00	1,004,138.08	
		1.45 ITALY GOVT 250515	2,300,000.00	2,248,887.10	
		1.45 ITALY GOVT 360301	2,140,000.00	1,666,193.30	
		1.45 SPAIN GOVT 271031	4,330,000.00	4,116,011.40	
		1.45 SPAIN GOVT 290430	3,300,000.00	3,079,467.60	
		1.45 SPAIN GOVT 711031	1,300,000.00	646,964.50	
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1,810,000.00	1,345,785.68	
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	460,000.00	277,909.00	
		1.5 FINNISH GOVT 320915	750,000.00	676,184.12	
		1.5 IRISH GOVT 500515	1,460,000.00	1,047,234.64	
		1.5 ITALY GOVT 250601	3,300,000.00	3,225,394.32	
		1.5 ITALY GOVT 450430	2,010,000.00	1,299,671.02	
		1.5 O.A.T 310525	9,560,000.00	8,814,506.42	
		1.5 O.A.T 500525	5,230,000.00	3,616,879.72	
		1.5 SPAIN GOVT 270430	4,290,000.00	4,107,614.94	
		1.6 BEL GOVT 470622	1,570,000.00	1,135,505.64	
		1.6 ITALY GOVT 260601	4,120,000.00	3,983,331.36	
		1.6 SPAIN GOVT 250430	3,510,000.00	3,442,836.15	
		1.65 ITALY GOVT 301201	3,870,000.00	3,479,679.54	

		1.65 ITALY GOVT 320301	4,450,000.00	3,905,876.25	
		1.7 BEL GOVT 500622	1,840,000.00	1,315,434.40	
		1.7 BUND 320815	4,350,000.00	4,129,411.50	
		1.7 IRISH GOVT 370515	1,190,000.00	1,032,417.82	
		1.7 ITALY GOVT 510901	2,650,000.00	1,648,533.20	
		1.75 O.A.T 390625	5,550,000.00	4,654,668.45	
		1.75 O.A.T 660525	2,590,000.00	1,759,412.90	
		1.8 BUND 530815	4,290,000.00	3,615,577.68	
		1.8 BUND 530815	1,000,000.00	843,867.38	
		1.8 ITALY GOVT 410301	2,950,000.00	2,157,635.90	
		1.85 AUSTRIA GOVT 490523	870,000.00	682,695.96	
		1.85 ITALY GOVT 250701	4,650,000.00	4,560,343.35	
		1.85 SPAIN GOVT 350730	3,510,000.00	3,036,501.00	
		1.9 BEL GOVT 380622	1,360,000.00	1,167,772.16	
		1.9 SPAIN GOVT 521031	3,170,000.00	2,152,407.81	
		1.95 SPAIN GOVT 260430	3,520,000.00	3,440,272.00	
		1.95 SPAIN GOVT 300730	3,790,000.00	3,577,505.76	
		2 AUSTRIA GOVT 260715	1,000,000.00	980,499.00	
		2 IRISH GOVT 450218	1,640,000.00	1,377,977.20	
		2 ITALY GOVT 251201	3,530,000.00	3,457,282.00	
		2 ITALY GOVT 280201	3,880,000.00	3,725,932.96	
		2 NETH GOVT 540115	1,310,000.00	1,113,251.10	
		2 O.A.T 321125	7,450,000.00	6,996,853.75	
		2 O.A.T 480525	4,970,000.00	3,930,131.87	
		2.05 ITALY GOVT 270801	2,650,000.00	2,562,014.70	
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	950,000.00	723,045.95	
		2.1 BUND 291115	4,460,000.00	4,385,292.45	
		2.1 ITALY GOVT 260715	2,350,000.00	2,294,738.55	
		2.1 OBL 290412	1,430,000.00	1,406,333.50	
		2.15 BEL GOVT 660622	1,530,000.00	1,159,862.40	
		2.15 ITALY GOVT 520901	1,550,000.00	1,051,656.40	
		2.15 ITALY GOVT 720301	1,150,000.00	716,077.79	
		2.15 SPAIN GOVT 251031	4,000,000.00	3,938,808.00	
		2.2 BUND 340215	1,720,000.00	1,686,159.00	
		2.2 ITALY GOVT 270601	3,380,000.00	3,288,412.14	
		2.2 OBL 280413	4,250,000.00	4,203,313.75	
		2.25 BEL GOVT 570622	1,020,000.00	796,377.19	
		2.25 ITALY GOVT 360901	2,720,000.00	2,305,776.64	
		2.3 BUND 330215	6,190,000.00	6,145,555.80	
		2.3 BUND 330215	950,000.00	943,684.40	
		2.35 SPAIN GOVT 330730	3,110,000.00	2,913,836.75	
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	1,690,000.00	1,618,083.74	

		2.4 BUND 301115	2,580,000.00	2,579,642.22	
		2.4 IRISH GOVT 300515	1,490,000.00	1,471,375.00	
		2.4 OBL 281019	4,820,000.00	4,803,703.58	
		2.45 ITALY GOVT 330901	2,870,000.00	2,617,681.08	
		2.45 ITALY GOVT 500901	2,490,000.00	1,843,426.68	
		2.5 BUND 440704	4,730,000.00	4,647,272.30	
		2.5 BUND 460815	4,950,000.00	4,871,255.40	
		2.5 BUND 540815	1,090,000.00	1,072,823.78	
		2.5 ITALY GOVT 251115	2,330,000.00	2,301,725.45	
		2.5 ITALY GOVT 321201	2,850,000.00	2,640,060.45	
		2.5 NETH GOVT 300115	600,000.00	596,400.60	
		2.5 NETH GOVT 330115	2,750,000.00	2,721,595.25	
		2.5 NETH GOVT 330715	1,650,000.00	1,626,993.22	
		2.5 NETH GOVT 340715	1,050,000.00	1,030,342.00	
		2.5 O.A.T 260924	7,300,000.00	7,233,883.90	
		2.5 O.A.T 270924	1,200,000.00	1,189,050.00	
		2.5 O.A.T 300525	9,590,000.00	9,483,993.29	
		2.5 O.A.T 430525	2,530,000.00	2,264,818.05	
		2.5 SCHATS 250313	1,000,000.00	991,253.00	
		2.5 SPAIN GOVT 270531	1,400,000.00	1,380,337.00	
		2.55 SPAIN GOVT 321031	3,560,000.00	3,418,529.16	
		2.6 BUND 330815	4,910,000.00	4,987,661.47	
		2.6 IRISH GOVT 341018	300,000.00	294,411.09	
		2.625 FINNISH GOV 420704	940,000.00	882,111.04	
		2.65 ITALY GOVT 271201	2,800,000.00	2,756,443.20	
		2.7 ITALY GOVT 470301	3,300,000.00	2,643,306.60	
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2,910,000.00	2,446,518.48	
		2.75 BEL GOVT 390422	950,000.00	903,690.35	
		2.75 FINNISH GOVT 280704	1,110,000.00	1,110,888.00	
		2.75 FINNISH GOVT 380415	680,000.00	656,370.00	
		2.75 NETH GOVT 470115	3,320,000.00	3,313,625.60	
		2.75 O.A.T 271025	10,320,000.00	10,322,239.44	
		2.75 O.A.T 290225	6,480,000.00	6,490,873.44	
		2.8 ITALY GOVT 281201	3,680,000.00	3,626,858.96	
		2.8 ITALY GOVT 290615	3,200,000.00	3,137,600.00	
		2.8 ITALY GOVT 670301	1,510,000.00	1,135,595.50	
		2.8 SCHATS 250612	3,470,000.00	3,450,151.77	
		2.8 SPAIN GOVT 260531	3,500,000.00	3,479,945.00	
		2.85 BEL GOVT 341022	590,000.00	584,432.76	
		2.875 FINNISH GOV 290415	600,000.00	604,175.40	
		2.9 AUSTRIA GOVT 290523	700,000.00	707,215.60	
		2.9 AUSTRIA GOVT 330220	2,180,000.00	2,187,303.00	
		2.9 AUSTRIA GOVT 340220	800,000.00	800,640.80	

		2.9 SPAIN GOVT 461031	2,990,000.00	2,639,003.90	
		2.95 FINNISH GOVT 550415	410,000.00	401,229.81	
		2.95 ITALY GOVT 270215	830,000.00	825,807.67	
		2.95 ITALY GOVT 380901	2,380,000.00	2,129,919.12	
		3 BEL GOVT 330622	2,750,000.00	2,778,690.75	
		3 BEL GOVT 340622	2,050,000.00	2,064,097.85	
		3 FINNISH GOVT 330915	920,000.00	929,965.44	
		3 IRISH GOVT 431018	690,000.00	688,586.88	
		3 ITALY GOVT 290801	3,400,000.00	3,365,476.40	
		3 O.A.T 330525	6,130,000.00	6,212,693.70	
		3 O.A.T 490625	1,080,000.00	1,032,836.40	
		3 O.A.T 540525	3,950,000.00	3,708,433.80	
		3.1 ITALY GOVT 400301	2,310,000.00	2,070,891.90	
		3.1 SCHATS 251212	4,000,000.00	4,004,524.00	
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	1,250,000.00	1,260,900.00	
		3.15 AUSTRIA GOVT 531020	660,000.00	664,204.20	
		3.15 SPAIN GOVT 330430	4,400,000.00	4,406,617.60	
		3.25 BUND 420704	3,190,000.00	3,483,910.65	
		3.25 ITALY GOVT 380301	2,220,000.00	2,063,312.40	
		3.25 ITALY GOVT 460901	2,740,000.00	2,416,663.56	
		3.25 NETH GOVT 440115	700,000.00	746,523.68	
		3.25 O.A.T 450525	4,710,000.00	4,721,525.37	
		3.25 SPAIN GOVT 340430	2,730,000.00	2,737,133.49	
		3.3 BEL GOVT 540622	1,690,000.00	1,658,887.10	
		3.35 ITALY GOVT 350301	3,110,000.00	3,009,186.24	
		3.4 ITALY GOVT 250328	2,300,000.00	2,296,860.50	
		3.4 ITALY GOVT 280401	3,000,000.00	3,030,564.00	
		3.45 AUSTRIA GOVT 301020	700,000.00	728,265.65	
		3.45 BEL GOVT 430622	800,000.00	817,819.20	
		3.45 ITALY GOVT 480301	2,820,000.00	2,553,978.12	
		3.45 SPAIN GOVT 430730	1,800,000.00	1,742,799.60	
		3.45 SPAIN GOVT 660730	2,230,000.00	2,053,448.67	
		3.5 BEL GOVT 550622	690,000.00	699,873.21	
		3.5 ITALY GOVT 260115	2,500,000.00	2,510,569.25	
		3.5 ITALY GOVT 300301	4,470,000.00	4,531,015.50	
		3.5 ITALY GOVT 310215	2,040,000.00	2,055,455.04	
		3.5 O.A.T 260425	6,690,000.00	6,765,864.60	
		3.5 O.A.T 331125	4,630,000.00	4,873,639.86	
		3.5 SPAIN GOVT 290531	1,000,000.00	1,028,705.00	
		3.55 SPAIN GOVT 331031	4,120,000.00	4,246,971.79	
		3.6 ITALY GOVT 250929	2,000,000.00	2,006,774.00	
		3.7 ITALY GOVT 300615	2,350,000.00	2,399,937.50	

		3.75 BEL GOVT 450622	1,620,000.00	1,730,155.14	
		3.75 NETH GOVT 420115	2,940,000.00	3,327,015.72	
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	700,000.00	806,506.40	
		3.8 ITALY GOVT 260415	2,700,000.00	2,731,514.40	
		3.8 ITALY GOVT 280801	3,090,000.00	3,170,759.31	
		3.85 ITALY GOVT 260915	1,450,000.00	1,473,891.65	
		3.85 ITALY GOVT 291215	2,600,000.00	2,679,326.00	
		3.85 ITALY GOVT 490901	2,450,000.00	2,353,176.00	
		3.9 SPAIN GOVT 390730	1,930,000.00	2,006,929.80	
		4 BEL GOVT 320328	1,250,000.00	1,358,112.50	
		4 BUND 370104	4,440,000.00	5,144,317.20	
		4 FINNISH GOVT 250704	240,000.00	242,367.60	
		4 ITALY GOVT 301115	2,220,000.00	2,304,983.82	
		4 ITALY GOVT 311030	1,650,000.00	1,717,323.30	
		4 ITALY GOVT 350430	2,150,000.00	2,208,376.80	
		4 ITALY GOVT 370201	4,950,000.00	5,050,712.70	
		4 NETH GOVT 370115	3,160,000.00	3,574,345.52	
		4 O.A.T 381025	4,020,000.00	4,452,994.20	
		4 O.A.T 550425	3,260,000.00	3,686,163.50	
		4 O.A.T 600425	3,180,000.00	3,644,105.10	
		4 SPAIN GOVT 541031	1,000,000.00	1,027,560.00	
		4.1 ITALY GOVT 290201	2,230,000.00	2,321,724.36	
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	2,540,000.00	2,850,121.30	
		4.15 ITALY GOVT 391001	1,830,000.00	1,857,971.55	
		4.2 ITALY GOVT 340301	3,430,000.00	3,590,264.33	
		4.2 SPAIN GOVT 370131	3,460,000.00	3,755,830.00	
		4.25 BEL GOVT 410328	2,740,000.00	3,104,776.20	
		4.25 BUND 390704	3,010,000.00	3,635,291.38	
		4.35 ITALY GOVT 331101	3,270,000.00	3,466,036.50	
		4.4 ITALY GOVT 330501	3,800,000.00	4,050,420.00	
		4.45 ITALY GOVT 430901	1,450,000.00	1,517,636.70	
		4.5 BEL GOVT 260328	1,610,000.00	1,658,746.93	
		4.5 ITALY GOVT 260301	3,740,000.00	3,828,914.76	
		4.5 ITALY GOVT 531001	2,200,000.00	2,310,946.00	
		4.5 O.A.T 410425	6,030,000.00	7,094,427.66	
		4.65 SPAIN GOVT 250730	2,890,000.00	2,942,106.70	
		4.7 SPAIN GOVT 410730	3,300,000.00	3,773,055.00	
		4.75 BUND 280704	2,340,000.00	2,553,262.92	
		4.75 BUND 340704	3,770,000.00	4,552,455.96	
		4.75 BUND 400704	3,330,000.00	4,274,887.50	
		4.75 ITALY GOVT 280901	3,930,000.00	4,188,893.07	
		4.75 ITALY GOVT 440901	3,200,000.00	3,490,752.00	
		4.75 O.A.T 350425	4,750,000.00	5,559,167.25	

		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	1,370,000.00	1,419,872.11	
		4.9 SPAIN GOVT 400730	3,310,000.00	3,846,236.55	
		5 BEL GOVT 350328	2,950,000.00	3,507,727.00	
		5 ITALY GOVT 250301	4,280,000.00	4,337,069.52	
		5 ITALY GOVT 340801	3,850,000.00	4,287,706.50	
		5 ITALY GOVT 390801	3,980,000.00	4,437,594.13	
		5 ITALY GOVT 400901	3,600,000.00	4,017,537.00	
		5.15 SPAIN GOVT 281031	3,250,000.00	3,565,900.00	
		5.15 SPAIN GOVT 441031	2,640,000.00	3,208,223.04	
		5.25 ITALY GOVT 291101	4,660,000.00	5,147,741.69	
		5.4 IRISH GOVT 250313	2,100,000.00	2,139,825.24	
		5.5 BEL GOVT 280328	3,380,000.00	3,737,435.00	
		5.5 BUND 310104	3,140,000.00	3,743,643.02	
		5.5 NETH GOVT 280115	2,180,000.00	2,403,726.86	
		5.5 O.A.T 290425	6,800,000.00	7,685,938.00	
		5.625 BUND 280104	2,540,000.00	2,820,862.53	
		5.75 ITALY GOVT 330201	4,320,000.00	5,039,323.20	
		5.75 O.A.T 321025	5,490,000.00	6,701,041.84	
		5.75 SPAIN GOVT 320730	3,980,000.00	4,773,463.94	
		5.9 SPAIN GOVT 260730	4,650,000.00	4,946,623.50	
		6 ITALY GOVT 310501	5,030,000.00	5,881,176.60	
		6 O.A.T 251025	5,760,000.00	6,014,868.48	
		6 SPAIN GOVT 290131	4,230,000.00	4,829,073.75	
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	1,630,000.00	1,807,826.48	
		6.25 BUND 300104	1,700,000.00	2,047,157.00	
		6.5 BUND 270704	2,680,000.00	3,003,082.04	
		6.5 ITALY GOVT 271101	3,900,000.00	4,353,047.40	
		7.25 ITALY GOVT 261101	2,300,000.00	2,536,486.00	
ユーロ合計			1,163,730,000.00	1,085,842,351.42 (175,558,991,377)	
合計				540,112,813,383 (540,112,813,383)	

(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	270銘柄	100.00%	46.56%
カナダドル	国債証券	38銘柄	100.00%	2.02%
オーストラリアドル	国債証券	27銘柄	100.00%	1.37%
イギリスポンド	国債証券	60銘柄	100.00%	5.21%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.00%	0.41%

マレーシアリンギット	国債証券	28銘柄	100.00%	0.51%
ニュージーランドドル	国債証券	12銘柄	100.00%	0.25%
スウェーデンクローネ	国債証券	8銘柄	100.00%	0.19%
ノルウェークローネ	国債証券	10銘柄	100.00%	0.17%
デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	100.00%	0.26%
メキシコペソ	国債証券	16銘柄	100.00%	0.91%
イスラエルシェケル	国債証券	11銘柄	100.00%	0.33%
ポーランドズロチ	国債証券	13銘柄	100.00%	0.52%
中国元	国債証券	76銘柄	100.00%	8.78%
ユーロ	国債証券	379銘柄	100.00%	32.50%

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】

【ワールド・インカムオープン】

【純資産額計算書】

2024年 3月29日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	2,579,577,222
Ⅱ　負債総額	1,170,105
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,578,407,117
Ⅳ　発行済口数	2,759,064,563口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9345
（10,000口当たり）	（9,345）

（参考）

外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年 3月29日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	594,333,687,800
Ⅱ　負債総額	8,788,889,603
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	585,544,798,197
Ⅳ　発行済口数	221,253,526,602口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	2.6465
（10,000口当たり）	（26,465）

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

2024年3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・管理委員会において、①で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

③運用計画の決定

②で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

④ポートフォリオの構築

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

⑤運用部門による自律的な運用管理

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、運用部門内の管理担当部署は逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また、運用戦略・管理委員会を通じて運用状況のモニタリングを行い、運用部門内での自律的牽制により運用改善を図ります。

⑥管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署は、（a）運用に関するパフォーマンス測定・分析のほか、（b）リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、（a）についてはファンド管理委員会を経て運用担当部・商品開発担当部にフィードバックされ、（b）についてはリスク管理委員会を通じて運用担当部にフィードバックされ、必要に応じて部署間連携の上で是正・改善の検討が行われます。

⑦ファンドに関係する法人等の管理

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

⑧運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

＜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。
2024年 3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	835	33,944,059
追加型公社債投資信託	16	1,579,518
単位型株式投資信託	96	430,318
単位型公社債投資信託	50	102,848
合　計	997	36,056,743

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）財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

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

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

（２）監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第38期事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第39期事業年度に係る中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	565,222	507,559
未払金		
未払収益分配金	197,334	114,094
未払償還金	7,418	7,418

未払手数料	※2	6,423,139	※2	6,139,595
その他未払金	※2	4,565,457	※2	955,697
未払費用	※2	4,328,968	※2	5,778,896
未払消費税等		1,112,923		439,657
未払法人税等		769,692		2,375,281
賞与引当金		942,287		849,840
役員賞与引当金		149,028		154,872
その他		5,517		5,517
流動負債合計		19,066,990		17,328,431
固定負債				
長期未払金		10,800		-
退職給付引当金		1,246,300		1,333,882
役員退職慰労引当金		117,938		75,667
時効後支払損引当金		250,214		254,296
固定負債合計		1,625,252		1,663,846
負債合計		20,692,243		18,992,277
(純資産の部)				
株主資本				
資本金		2,000,131		2,000,131
資本剰余金				
資本準備金		3,572,096		3,572,096
その他資本剰余金		41,160,616		41,160,616
資本剰余金合計		44,732,712		44,732,712
利益剰余金				
利益準備金		342,589		342,589
その他利益剰余金				
別途積立金		6,998,000		6,998,000
繰越利益剰余金		29,000,498		33,267,700
利益剰余金合計		36,341,088		40,608,289
株主資本合計		83,073,932		87,341,133

(単位：千円)

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

（２）【損益計算書】

(単位：千円)

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

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

（単位：千円）

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）		第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金		243,133		47,353
受取利息	※2	7,408	※2	10,279
投資有価証券償還益		1,089,101		609,102
収益分配金等時効完成分		137,485		94,351
受取賃貸料	※2	65,808	※2	65,808

その他		36,211		36,894
営業外収益合計		1,579,148		863,788
営業外費用				
投資有価証券償還損		3,074		32,995
時効後支払損引当金繰入		16,548		31,951
事務過誤費		76,076		2,680
賃貸関連費用		15,780		14,262
その他		7,585		32,394
営業外費用合計		119,066		114,284
経常利益		17,011,221		15,012,711
特別利益				
投資有価証券売却益		605,706		387,113
特別利益合計		605,706		387,113
特別損失				
投資有価証券売却損		28,188		15,828
投資有価証券評価損		36,558		104,554
固定資産除却損	※1	13,094	※1	32,791
減損損失		-	※3	315,350
特別損失合計		77,840		468,524
税引前当期純利益		17,539,087		14,931,300
法人税、住民税及び事業税	※2	5,366,608	※2	4,860,444
法人税等調整額		22,446		△271,471
法人税等合計		5,389,054		4,588,973
当期純利益		12,150,032		10,342,327

（３）【株主資本等変動計算書】

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

(単位：千円)

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

	利益剰余金	

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

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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

(単位：千円)

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

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

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

[注記事項]

（重要な会計方針）

1.有価証券の評価基準及び評価方法

(1)子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2)その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2.金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3.固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産及び投資不動産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物　5年～50年
器具備品　2年～20年
投資不動産　5年～47年

(2)無形固定資産

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

4.外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準
外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5.引当金の計上基準
(1)貸倒引当金
貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。
(2)賞与引当金
従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。
(3)役員賞与引当金
役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。
(4)退職給付引当金
従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。
①退職給付見込額の期間帰属方法
退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。
②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法
過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理することとしております。
数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（主として10年）による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。
(5)役員退職慰労引当金
役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。
(6)時効後支払損引当金
時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

6.収益及び費用の計上基準
当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主要な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。
(1)委託者報酬
投資信託の信託約款に基づき信託財産の運用指図等を行っております。委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を投資信託によって主に年2回受領しております。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。
(2)投資顧問料
顧客との投資一任及び投資助言契約に基づき運用及び助言を行っております。投資顧問料は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を主に年4回受領しております。当該報酬は契約期間にわたり収益として認識しております。

7.その他財務諸表作成のための基礎となる事項
グループ通算制度の適用
グループ通算制度を適用しております。

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

（貸借対照表関係）
※1.有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
建物	805,250千円	1,006,606千円
器具備品	2,054,366千円	1,985,072千円
投資不動産	157,995千円	163,978千円

※2.関係会社に対する主な資産・負債
区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
預金	43,782,913千円	40,165,058千円
未収収益	13,741千円	15,046千円
未払手数料	836,105千円	790,279千円
その他未払金	3,887,520千円	77,007千円
未払費用	337,847千円	277,358千円

（損益計算書関係）
※1.固定資産除却損の内訳

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
建物	2,599千円	1,047千円
器具備品	10,495千円	29,762千円
ソフトウェア	-	1,981千円
計	13,094千円	32,791千円

※2.関係会社に対する主な取引
区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
支払手数料	5,153,589千円	4,893,312千円
受取利息	7,377千円	10,236千円
受取賃貸料	65,808千円	68,168千円
法人税、住民税及び事業税	4,062,765千円	3,947,200千円

※3.減損損失
当社は、以下のとおり減損損失を計上しました。

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

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグルーピングとしております。
翌期において、ホームページのリニューアルを予定しており、現行のホームページについて将来の利用終了が見込まれるため帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。
なお、回収可能価額として使用価値を用いておりますが、割引率については使用見込期間が短いため考慮していません。

（株主資本等変動計算書関係）
第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数　(株)	当事業年度増加 株式数　(株)	当事業年度減少 株式数　(株)	当事業年度末 株式数　(株)
発行済株式				
普通株式	211,581	－	－	211,581
合計	211,581	－	－	211,581

2.配当に関する事項

(1)配当金支払額

2021年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

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

2022年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数　(株)	当事業年度増加 株式数　(株)	当事業年度減少 株式数　(株)	当事業年度末 株式数　(株)
発行済株式				
普通株式	211,581	－	－	211,581
合計	211,581	－	－	211,581

2.配当に関する事項

(1)配当金支払額

2022年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

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

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

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

（リース取引関係）

〈借主側〉

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

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

合計	1,123,863千円	2,495,537千円

（金融商品関係）

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

2.金融商品の時価等に関する事項

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

第37期(2022年3月31日現在)

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

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

（注2）　市場価格のない株式等

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

（注3）　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

（注4）　金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第37期(2022年3月31日現在)　（単位：千円）

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

第38期(2023年3月31日現在)

		貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1)	有価証券	1,579,691	1,579,691	－
(2)	金銭の信託	10,400,000	10,400,000	－
(3)	投資有価証券	12,022,365	12,022,365	－
	資産計	24,002,056	24,002,056	－

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

（注2）　市場価格のない株式等

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

（注3）　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

（注4）　金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第38期(2023年3月31日現在)　（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	51,733,041	－	－	－
金銭の信託	10,400,000	－	－	－
未収委託者報酬	16,753,855	－	－	－
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	1,579,691	4,859,714	1,433,213	－
合計	80,466,587	4,859,714	1,433,213	－

3.金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

第37期(2022年3月31日現在)

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

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

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

第38期(2023年3月31日現在)

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

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

金銭の信託

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

（有価証券関係）

1.子会社株式及び関連会社株式

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

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

2.その他有価証券

第37期(2022年3月31日現在)

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

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

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

第38期(2023年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株式	―	―	―
	債券	―	―	―
	その他	8,983,713	7,558,314	1,425,399
	小計	8,983,713	7,558,314	1,425,399
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株式	―	―	―
	債券	―	―	―
	その他	15,018,343	15,474,760	△456,417
	小計	15,018,343	15,474,760	△456,417
合計		24,002,056	23,033,074	968,982

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

3.売却したその他有価証券

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
株式	―	―	―
債券	―	―	―

その他	4,164,921	605,706	28,188
合計	4,164,921	605,706	28,188

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
株式	17,240	―	14,120
債券	―	―	―
その他	1,551,405	387,113	1,708
合計	1,568,645	387,113	15,828

4.減損処理を行った有価証券

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

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

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

（退職給付関係）

1.採用している退職給付制度の概要

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

2.確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

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

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

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

(5)年金資産に関する事項

①年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

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

②長期期待運用収益率の設定方法

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

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3.確定拠出制度

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

（税効果会計関係）

1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2.法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

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

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

3.法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

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

（収益認識関係）

1.顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

2.顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

3.顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業

年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

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

1.製品及びサービスごとの情報

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

2.地域ごとの情報

（1）営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3.主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1.関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注5）	科目	期末残高（注5）
親会社	㈱三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,141,513百万円	銀行持株会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税	連結納税に伴う支払（注1）	4,062,765千円	その他未払金	3,887,520千円
親会社	三菱UFJ信託銀行㈱	東京都千代田区	324,279百万円	信託業、銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注2）	5,153,589千円	未払手数料	836,105千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料（注3）	499,388千円	未払費用	272,264千円

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注5）	科目	期末残高（注5）
親会社	㈱三菱UFJ フィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,141,513百万円	銀行持株会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税等	連結納税等に伴う支払（注4）	3,947,200千円	その他未払金	77,007千円
親会社	三菱UFJ信託銀行㈱	東京都千代田区	324,279百万円	信託業、銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注2）	4,893,312千円	未払手数料	790,279千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料（注3）	463,416千円	未払費用	253,093千円

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．連結納税制度及びグループ通算制度に基づく法人税の支払予定額であります。
５．上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注2）	科目	期末残高（注2）
同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注1）	4,097,951千円	未払手数料	838,058千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注1）	7,025,984千円	未払手数料	1,319,958千円

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注2）	科目	期末残高（注2）

同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注1）	4,052,979千円	未払手数料	868,785千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注1）	6,661,991千円	未払手数料	1,218,051千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2.親会社に関する注記

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

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社（非上場）

（１株当たり情報）

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
１株当たり純資産額	400,322.84円	415,979.76円
１株当たり当期純利益金額	57,424.97円	48,881.17円

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

2．１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
当期純利益金額　（千円）	12,150,032	10,342,327
普通株主に帰属しない金額　（千円）	―	―
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	12,150,032	10,342,327
普通株式の期中平均株式数　（株）	211,581	211,581

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

	第39期中間会計期間 (2023年9月30日現在)
(資産の部)	
流動資産	

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

(単位：千円)

		第39期中間会計期間 (2023年9月30日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金		492,861
未払金		
未払収益分配金		105,556
未払償還金		44,768
未払手数料		6,929,093
その他未払金		3,313,588
未払費用		6,935,916
未払消費税等	※2	319,737
未払法人税等		2,205,065
賞与引当金		899,167
役員賞与引当金		78,660
その他		5,517
流動負債合計		21,329,934
固定負債		
退職給付引当金		1,375,952

役員退職慰労引当金	32,510
時効後支払損引当金	252,955
資産除去債務	704,072
固定負債合計	2,365,490
負債合計	23,695,424
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,131
資本剰余金	
資本準備金	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712
利益剰余金	
利益準備金	342,589
その他利益剰余金	
別途積立金	6,998,000
繰越利益剰余金	33,502,194
利益剰余金合計	40,842,784
株主資本合計	87,575,628

(単位：千円)

	第39期中間会計期間 (2023年9月30日現在)
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,055,167
評価・換算差額等合計	1,055,167
純資産合計	88,630,795
負債純資産合計	112,326,220

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

	第39期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
営業収益	
委託者報酬	47,550,495
投資顧問料	1,407,644
その他営業収益	10,158
営業収益合計	48,968,298
営業費用	
支払手数料	16,737,084
広告宣伝費	208,241
公告費	892
調査費	
調査費	1,594,100
委託調査費	12,907,263
事務委託費	947,553
営業雑経費	
通信費	53,048
印刷費	194,402
協会費	33,149
諸会費	9,640
事務機器関連費	1,212,110
その他営業雑経費	5,384

営業費用合計		33,902,872
一般管理費		
給料		
役員報酬		190,163
給料・手当		2,957,056
賞与引当金繰入		899,167
役員賞与引当金繰入		78,660
福利厚生費		645,394
交際費		4,144
旅費交通費		46,547
租税公課		204,887
不動産賃借料		390,491
退職給付費用		188,933
固定資産減価償却費	※1	1,169,259
諸経費		275,931
一般管理費合計		7,050,636
営業利益		8,014,788

（単位：千円）

	第39期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金		27,966
受取利息		6,353
投資有価証券償還益		19,971
収益分配金等時効完成分		15,896
受取賃貸料		36,751
その他		20,823
営業外収益合計		127,762
営業外費用		
投資有価証券償却損		53,716
時効後支払損引当金繰入		1,347
事務過誤費		10,736
賃貸関連費用	※1	16,188
その他		3,902
営業外費用合計		85,890
経常利益		8,056,659
特別利益		
投資有価証券売却益		132,206
固定資産売却益		1,021
特別利益合計		133,228
特別損失		
投資有価証券売却損		30,309
投資有価証券評価損		28,130
固定資産除却損		20,162
固定資産売却損		65,427
その他特別損失		289,389
特別損失合計		433,419
税引前中間純利益		7,756,468
法人税、住民税及び事業税		2,118,856
法人税等調整額		232,077
法人税等合計		2,350,934
中間純利益		5,405,533

(3)中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

(単位：千円)

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

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

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

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	5年～50年
器具備品	2年～20年
投資不動産	3年～50年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

4．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

① 退職給付見込額の期間帰属方法

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

② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5) 役員退職慰労引当金

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

(6) 時効後支払損引当金

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

5．収益および費用の計上基準

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

(1) 委託者報酬

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

(2)　投資顧問料

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

6．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

7．その他中間財務諸表作成のための重要な事項

グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

[注記事項]

（中間貸借対照表関係）

※1　減価償却累計額

	第39期中間会計期間 （2023年9月30日現在）
建物	407,329千円
器具備品	1,336,738千円
投資不動産	170,993千円

※2　消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

（中間損益計算書関係）

※1　減価償却実施額

	第39期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
有形固定資産	225,710千円
無形固定資産	943,548千円
投資不動産	7,015千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当中間会計期間 増加株式数（株）	当中間会計期間 減少株式数（株）	当中間会計期間末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	211,581	－	－	211,581
合計	211,581	－	－	211,581

2．配当に関する事項

2023年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

（リース取引関係）

第39期中間会計期間(2023年9月30日現在)

〈借主側〉

オペレーティング・リース取引
オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

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

（金融商品関係）
第39期中間会計期間(2023年9月30日現在)
1．　金融商品の時価等に関する事項
　2023年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

	中間貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1)　有価証券	1,621,227	1,621,227	―
(2)　金銭の信託	10,401,000	10,401,000	―
(3)　投資有価証券	14,016,994	14,016,994	―
資産計	26,039,221	26,039,221	

（注1）「現金及び預金」、「未収委託者報酬」、「未払手数料」については短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。
（注2）市場価格のない株式等
　関連会社株式（中間貸借対照表計上額 159,536千円）は、市場価格がないため、記載しておりません。
（注3）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明
　金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。

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

時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産

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

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券
　ETF（上場投資信託）は相場価格を用いて評価しております。ETFは活発な市場で取引されているため、レベル1の時価に分類しております。
　ETF（上場投資信託）以外の投資信託は基準価額を用いて評価しております。基準価額は観察可能なインプットを用いて算出しているため、レベル2の時価に分類しております。
金銭の信託

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

（有価証券関係）

第39期中間会計期間（2023年9月30日現在）

1．子会社及び関連会社株式

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

2．その他有価証券

	種類	中間貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株式	―	―	―
	債券	―	―	―
	その他	15,250,611	13,190,791	2,059,819
	小　計	15,250,611	13,190,791	2,059,819
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株式	―	―	―
	債券	―	―	―
	その他	10,788,610	11,327,577	△538,966
	小　計	10,788,610	11,327,577	△538,966
合　計		26,039,221	24,518,369	1,520,852

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

3．減損処理を行った有価証券

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

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

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの

当該資産除去債務の総額の増減

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

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

（１株当たり情報）

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第39期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
1株当たり中間純利益金額	25,548.29円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額（千円）	5,405,533
普通株主に帰属しない金額（千円）	―
普通株式に係る中間純利益金額（千円）	5,405,533
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581

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

（重要な後発事象）

共通支配下の取引等

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

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

(1) 取引の概要

①被取得企業の名称及びその事業の内容

被取得企業の名称　三菱ＵＦＪ不動産投資顧問株式会社

事業の内容　投資顧問業、私募投資信託の設定・運用等

②企業結合日

2023年10月1日

③企業結合の法的形式

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

④結合後企業の名称

分割会社：三菱ＵＦＪ不動産投資顧問株式会社

承継会社：三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

⑤企業結合を行う主な理由

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

(2)　実施する会計処理の概要

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

５【その他】

＜訂正前＞

①定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

②訴訟事件その他重要事項

委託会社は2023年10月１日にエム・ユー投資顧問株式会社の有価証券運用事業を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社へ統合し、商号を三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社に変更しました。

上記以外、該当事項はありません。

＜訂正後＞

①定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

②訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

＜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（2023年９月末現在）

③事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

（２）販売会社

①名称	②資本金の額 （2023年９月末現在）	③事業の内容
株式会社千葉銀行	145,069　百万円	銀行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	54,323　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	19,495　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。
松井証券株式会社	11,945　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。（2023年10月１日現在）

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社は委託会社の株式の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＞

該当ありません。（2024年４月１日現在）

（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。

独　立　監　査　人　の　監　査　報　告　書

2024年5月22日

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　御　中

PwC Japan有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　大畑　茂

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　西郷　篤

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」に掲げられているワールド・インカムオープンの2023年9月16日から2024年3月15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、ワールド・インカムオープンの2024年3月15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アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

次へ

独立監査人の監査報告書

2023年6月9日

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
取　締　役　会　　御　中

有限責任監査法人トーマツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員　業務執行社員　公認会計士　青　木　裕　晃

指定有限責任社員　業務執行社員　公認会計士　伊　藤　鉄　也

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱ＵＦＪ国際投信株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第38期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱ＵＦＪ国際投信株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

会社と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。

独立監査人の中間監査報告書

2023年12月1日

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御　中

有限責任監査法人ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　山　田　信　之

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　田　嶋　大　士

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

利害関係

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

以　上

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