

## 【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10月16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<br>信託受益証券に係るファンドの名称】 | 三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型） |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>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】

2024年4月16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および申込受付時間変更の予定記載等を行うため、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】

## （１）【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt; 更新後 &gt;

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

信託金の限度額は、3,000億円です。

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

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

## 商品分類表

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

## 属性区分表

| 投資対象資産             | 決算頻度       | 投資対象地域      | 投資形態                     | 為替<br>ヘッジ | 対象<br>インデックス | 特殊型        |
|--------------------|------------|-------------|--------------------------|-----------|--------------|------------|
| 株式                 | 年１回        | グローバル       | ファミ<br>リー<br>ファンド        | あり        | 日経２２５        | ブル・ベア型     |
| 一般                 | 年２回        | (日本を除く)     |                          | ( )       |              |            |
| 大型株<br>中小型株        | 年４回<br>年６回 | 日本<br>北米    | ファン<br>ド・<br>オブ・<br>ファンズ | なし        | TOPIX        | 条件付運用型     |
| 債券                 | (隔月)       | 欧州          |                          |           | その他          | ロング・       |
| 一般                 | 年12回       | アジア         |                          |           | (FTSE世界      | ショート型／     |
| 公債                 | (毎月)       | オセアニア       |                          |           | 国債インデッ<br>クス | 絶対収益       |
| 社債                 | 日々         | 中南米         |                          |           | (除く日本、       | 追求型        |
| その他債券              | その他        | アフリカ        |                          |           | 円換算ベー<br>ス)  |            |
| クレジット<br>属性<br>( ) | ( )        | 中近東<br>(中東) |                          |           |              | その他<br>( ) |
| 不動産投信              |            | エマージング      |                          |           |              |            |

|                                                                  |  |  |  |  |  |  |
|------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|--|--|
| その他資産<br>（投資信託証券<br>（債券 一般<br>クレジット属性<br>（高格付債）））<br>資産複合<br>（ ） |  |  |  |  |  |  |
|------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|--|--|

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）でご覧いただけます。

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

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

#### 商品分類の定義

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

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

## 属性区分の定義

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

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

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

## [ ファンドの目的・特色 ]

## ファンドの目的

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

## ファンドの特色

特色

1

日本を除く世界各国の公社債を実質的な主要投資対象とします。

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

特色

2

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

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)をベンチマークとします。

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

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

### <運用プロセスのイメージ>

#### ステップ1：投資対象ユニバースの作成

↓ ベンチマーク採用銘柄を主要投資対象とします。

#### ステップ2：ポートフォリオ案の作成

↓ モニタリング結果に加えて、ファンドの資金動向やベンチマーク構成の変動などを考慮してポートフォリオ案を作成します。

#### ステップ3：売買執行

↓ 売買執行の際には、売買コストの抑制に留意します。

#### ステップ4：モニタリング

一連の投資行動を分析し、その結果をポートフォリオに反映することで、運用の継続的な改善に努めます。

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

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

ファンドが連動をめざすFTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)は日本を除く世界主要国の国債(投資適格債)のみを対象としており、したがってファンドは日本を除く世界各国の公社債の中から投資適格債を実質的な主要投資対象として運用を行います。

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

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

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

### 特色3

#### 原則として為替ヘッジを行いません。

為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。  
ただし、市況動向<sup>※</sup>の判断により、為替ヘッジを行う場合があります。

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

### 特色4

#### 組入れ国債等の利子・配当収益を中心に、原則として毎月分配を行う方針です。

毎月17日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、基準価額水準、市況動向等を勘案したうえで安定した分配を継続することをめざします。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないこともあります。また、基準価額水準、運用状況等によっては安定した分配とならないことがあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

## 収益分配金に関する留意事項

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

投資信託から分配金が  
支払われるイメージ



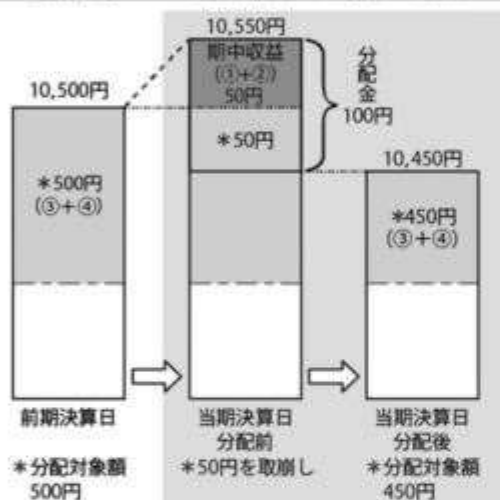
- ◆分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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

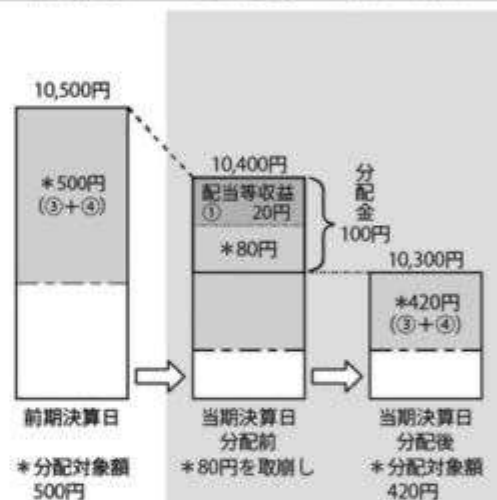
分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

## 計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

## 前期決算日から基準価額が上昇した場合



## 前期決算日から基準価額が下落した場合



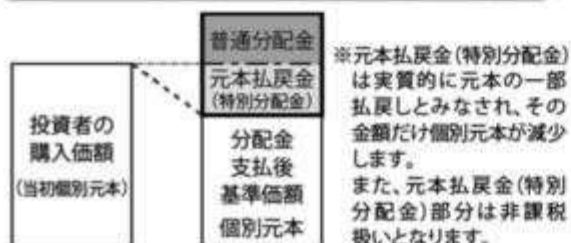
※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

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

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

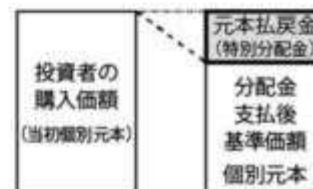
- ◆投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

## 分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



※元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

## 分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

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

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

## ■ファンドの仕組み

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



## ■主な投資制限

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

## （３）【ファンドの仕組み】

### <訂正前>

#### 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<br>「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。<br>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<br>「投資信託受益権の取扱いに関する契約」 | 販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。                                                                 |

#### 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  
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<br>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% |

## &lt;訂正後&gt;

## 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<br>「信託契約」              | 運用に関する事項、委託会社および受託会社と<br>しての業務に関する事項、受益者に関する事項<br>等が定められています。<br>なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に<br>関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届<br>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<br>「投資信託受益権の取扱いに関する契約」 | 販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益<br>分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の<br>内容等が定められています。                                                                         |

## 委託会社の概況（2024年7月末現在）

## ・金融商品取引業者登録番号

金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号

## ・設立年月日

1985年8月1日

## ・資本金

2,000百万円

## ・沿革

1997年5月

東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始

2004年10月

東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式  
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  
社に変更

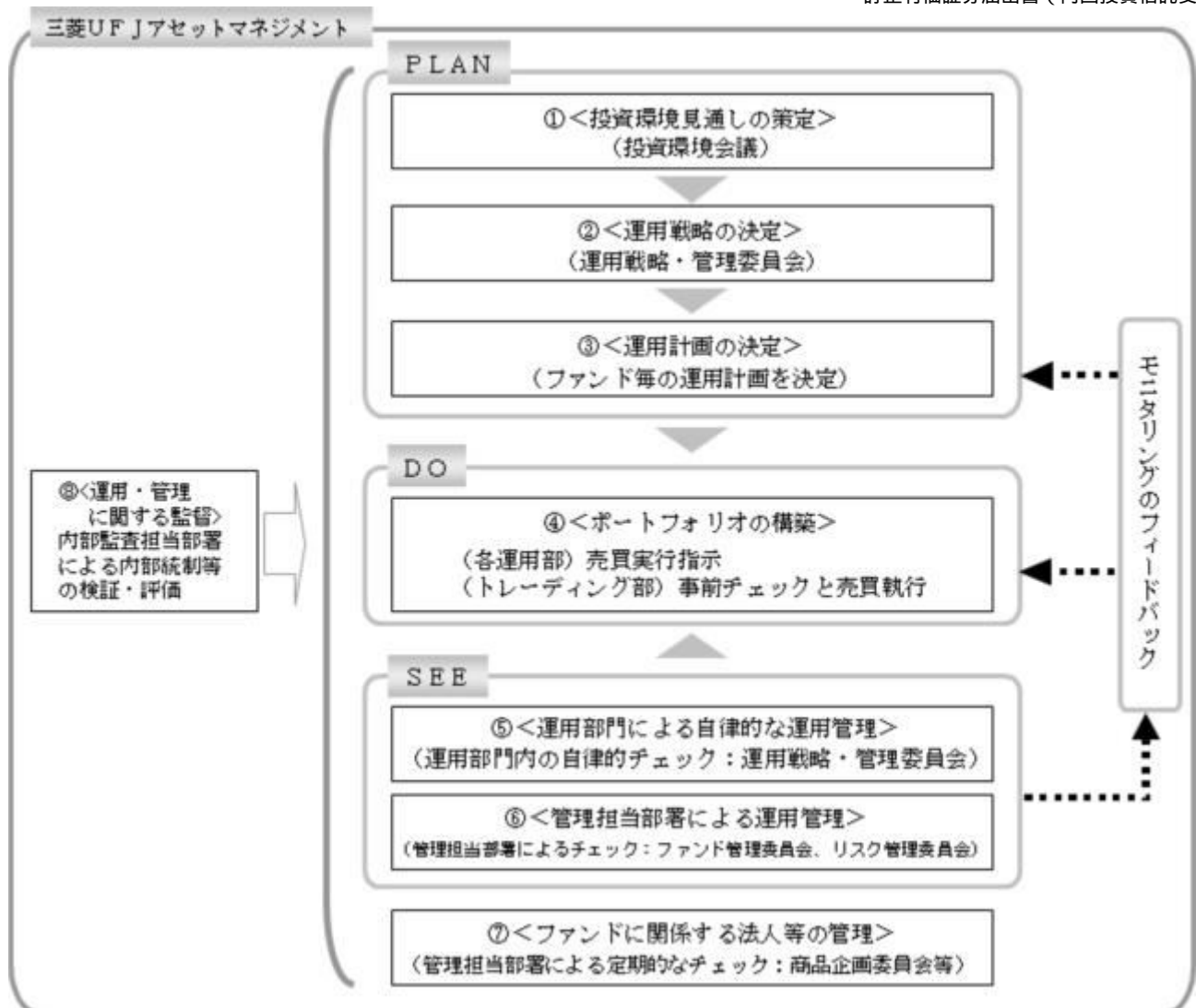
## ・大株主の状況

| 株 主 名                     | 住 所               | 所有株式数    | 所有比率   |
|---------------------------|-------------------|----------|--------|
| 株式会社三菱ＵＦＪフィナ<br>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】

## &lt;更新後&gt;



#### 投資環境見通しの策定

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

#### 運用戦略の決定

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

#### 運用計画の決定

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

#### ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部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。

#### 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。

#### 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。

#### ファンドに係る法人等の管理

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

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

#### 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/investment\\_policy/fm.html](https://www.am.mufg.jp/investment_policy/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。

（主なりスクであり、以下に限定されるものではありません。）

#### 価格変動リスク

一般に、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動するため、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。

#### 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。

#### 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。

#### 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が中止となる

可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・当ファンドは、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに概ね連動することをめざして運用を行います。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乖離を生じることがあります。
- ・投資対象国における社会情勢の混乱や資産凍結を含む重大な規制の導入等による影響を受けることにより、価格変動・為替変動・信用・流動性のリスクが大きくなる可能性があります。

## （２）投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行い、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。

### 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。

### 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。

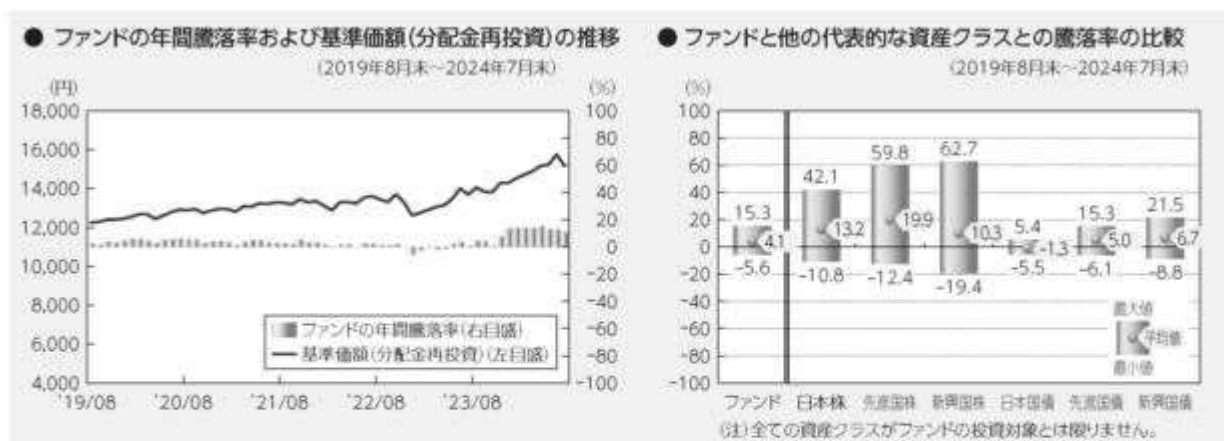
### 内部監査担当部署

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

\* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

## ■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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



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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

## 代表的な資産クラスの指数について

| 資産クラス | 指数名                            | 注記等                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|-------|--------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 日本株   | 東証株価指数 (TOPIX)<br>(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<br>(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<br>(除く日本)       | FTSE世界国債インデックス (除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 |
| 新興国債  | JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド    | JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当該指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。                                                                                                                                       |

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

## 4【手数料等及び税金】

### (5)【課税上の取扱い】

## &lt; 更新後 &gt;

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

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

１．収益分配金の課税

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

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

２．解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

公募株式投資信託は税法上、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。

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

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

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

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

収益分配金について

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

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

ます。

上記は2024年7月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。  
課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

(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7月19日～2024年1月17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 |
|-----------|------------|-----------|
| 0.84%     | 0.82%      | 0.02%     |

(比率は年率、表示桁数未満四捨五入)

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

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】

【三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）】

(１)【投資状況】

2024年 7月31日現在  
(単位：円)

| 資産の種類                    | 国／地域 | 時価合計          | 投資比率(%) |
|--------------------------|------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券                | 日本   | 1,030,513,207 | 99.99   |
| コール・ローン、その他資産<br>(負債控除後) | —    | 104,037       | 0.01    |
| 純資産総額                    |      | 1,030,617,244 | 100.00  |

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

(２)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

2024年 7月31日現在

| 国／地域 | 種類        | 銘柄名               | 数量          | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|-----------|-------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 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 | 381,360,820 | 2.8116          | 1,072,269,925   | 2.7022          | 1,030,513,207   | 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 7月31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。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## ( 3 ) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

下記計算期間末日および2024年7月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

( 単位：円 )

|            |               | 純資産総額         |               | 基準価額<br>(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88計算期間末日  | (2014年 8月18日) | 1,316,209,146 | 1,318,485,699 | 9,251                  | 9,267   |
| 第89計算期間末日  | (2014年 9月17日) | 1,341,013,272 | 1,343,287,257 | 9,436                  | 9,452   |
| 第90計算期間末日  | (2014年10月17日) | 1,338,915,441 | 1,341,191,243 | 9,413                  | 9,429   |
| 第91計算期間末日  | (2014年11月17日) | 1,407,946,724 | 1,410,163,822 | 10,161                 | 10,177  |
| 第92計算期間末日  | (2014年12月17日) | 1,390,683,801 | 1,392,845,626 | 10,293                 | 10,309  |
| 第93計算期間末日  | (2015年 1月19日) | 1,358,135,163 | 1,360,285,841 | 10,104                 | 10,120  |
| 第94計算期間末日  | (2015年 2月17日) | 1,337,307,109 | 1,339,435,731 | 10,052                 | 10,068  |
| 第95計算期間末日  | (2015年 3月17日) | 1,339,507,574 | 1,341,650,092 | 10,003                 | 10,019  |
| 第96計算期間末日  | (2015年 4月17日) | 1,329,129,260 | 1,331,260,455 | 9,978                  | 9,994   |
| 第97計算期間末日  | (2015年 5月18日) | 1,343,485,964 | 1,345,618,950 | 10,078                 | 10,094  |
| 第98計算期間末日  | (2015年 6月17日) | 1,330,412,332 | 1,332,514,484 | 10,126                 | 10,142  |
| 第99計算期間末日  | (2015年 7月17日) | 1,299,908,054 | 1,301,976,540 | 10,055                 | 10,071  |
| 第100計算期間末日 | (2015年 8月17日) | 1,326,495,189 | 1,328,568,512 | 10,237                 | 10,253  |
| 第101計算期間末日 | (2015年 9月17日) | 1,282,985,640 | 1,285,060,414 | 9,894                  | 9,910   |
| 第102計算期間末日 | (2015年10月19日) | 1,291,153,215 | 1,293,229,221 | 9,951                  | 9,967   |
| 第103計算期間末日 | (2015年11月17日) | 1,280,778,986 | 1,282,849,894 | 9,895                  | 9,911   |
| 第104計算期間末日 | (2015年12月17日) | 1,270,776,060 | 1,272,840,844 | 9,847                  | 9,863   |
| 第105計算期間末日 | (2016年 1月18日) | 1,226,001,062 | 1,228,076,843 | 9,450                  | 9,466   |
| 第106計算期間末日 | (2016年 2月17日) | 1,212,731,907 | 1,214,791,536 | 9,421                  | 9,437   |
| 第107計算期間末日 | (2016年 3月17日) | 1,201,437,733 | 1,203,498,399 | 9,329                  | 9,345   |
| 第108計算期間末日 | (2016年 4月18日) | 1,178,717,073 | 1,180,803,025 | 9,041                  | 9,057   |
| 第109計算期間末日 | (2016年 5月17日) | 1,194,333,428 | 1,196,434,677 | 9,094                  | 9,110   |
| 第110計算期間末日 | (2016年 6月17日) | 1,163,352,288 | 1,165,465,096 | 8,810                  | 8,826   |
| 第111計算期間末日 | (2016年 7月19日) | 1,173,731,214 | 1,175,848,760 | 8,869                  | 8,885   |
| 第112計算期間末日 | (2016年 8月17日) | 1,129,895,028 | 1,132,016,003 | 8,524                  | 8,540   |
| 第113計算期間末日 | (2016年 9月20日) | 1,126,061,540 | 1,128,185,634 | 8,482                  | 8,498   |
| 第114計算期間末日 | (2016年10月17日) | 1,129,159,475 | 1,131,283,621 | 8,505                  | 8,521   |
| 第115計算期間末日 | (2016年11月17日) | 1,138,180,599 | 1,140,310,701 | 8,549                  | 8,565   |
| 第116計算期間末日 | (2016年12月19日) | 1,198,513,277 | 1,200,629,004 | 9,064                  | 9,080   |
| 第117計算期間末日 | (2017年 1月17日) | 1,163,395,576 | 1,165,494,024 | 8,871                  | 8,887   |

|            |               |               |               |       |       |
|------------|---------------|---------------|---------------|-------|-------|
| 第118計算期間末日 | (2017年 2月17日) | 1,145,864,739 | 1,147,944,735 | 8,814 | 8,830 |
| 第119計算期間末日 | (2017年 3月17日) | 1,144,288,556 | 1,146,370,450 | 8,794 | 8,810 |
| 第120計算期間末日 | (2017年 4月17日) | 1,099,655,400 | 1,101,733,889 | 8,465 | 8,481 |
| 第121計算期間末日 | (2017年 5月17日) | 1,158,401,282 | 1,160,477,722 | 8,926 | 8,942 |
| 第122計算期間末日 | (2017年 6月19日) | 1,151,365,597 | 1,153,430,201 | 8,923 | 8,939 |
| 第123計算期間末日 | (2017年 7月18日) | 1,165,264,820 | 1,167,324,523 | 9,052 | 9,068 |
| 第124計算期間末日 | (2017年 8月17日) | 1,160,970,707 | 1,163,034,858 | 8,999 | 9,015 |
| 第125計算期間末日 | (2017年 9月19日) | 1,182,112,068 | 1,184,171,545 | 9,184 | 9,200 |
| 第126計算期間末日 | (2017年10月17日) | 1,160,475,383 | 1,162,504,073 | 9,153 | 9,169 |
| 第127計算期間末日 | (2017年11月17日) | 1,153,562,619 | 1,155,571,663 | 9,187 | 9,203 |
| 第128計算期間末日 | (2017年12月18日) | 1,152,277,964 | 1,154,281,801 | 9,201 | 9,217 |
| 第129計算期間末日 | (2018年 1月17日) | 1,144,435,554 | 1,146,442,166 | 9,125 | 9,141 |
| 第130計算期間末日 | (2018年 2月19日) | 1,094,230,159 | 1,096,234,978 | 8,733 | 8,749 |
| 第131計算期間末日 | (2018年 3月19日) | 1,096,477,071 | 1,098,498,971 | 8,677 | 8,693 |
| 第132計算期間末日 | (2018年 4月17日) | 1,120,499,621 | 1,122,526,736 | 8,844 | 8,860 |
| 第133計算期間末日 | (2018年 5月17日) | 1,109,797,889 | 1,111,825,074 | 8,759 | 8,775 |
| 第134計算期間末日 | (2018年 6月18日) | 1,093,174,938 | 1,095,182,436 | 8,713 | 8,729 |
| 第135計算期間末日 | (2018年 7月17日) | 1,122,553,012 | 1,124,563,985 | 8,931 | 8,947 |
| 第136計算期間末日 | (2018年 8月17日) | 1,083,095,933 | 1,085,105,243 | 8,625 | 8,641 |
| 第137計算期間末日 | (2018年 9月18日) | 1,101,064,984 | 1,103,077,259 | 8,755 | 8,771 |
| 第138計算期間末日 | (2018年10月17日) | 1,083,189,089 | 1,085,186,253 | 8,678 | 8,694 |
| 第139計算期間末日 | (2018年11月19日) | 1,075,875,482 | 1,077,865,567 | 8,650 | 8,666 |
| 第140計算期間末日 | (2018年12月17日) | 1,090,589,198 | 1,092,582,331 | 8,755 | 8,771 |
| 第141計算期間末日 | (2019年 1月17日) | 1,059,147,369 | 1,061,140,877 | 8,501 | 8,517 |
| 第142計算期間末日 | (2019年 2月18日) | 1,078,506,729 | 1,080,506,765 | 8,628 | 8,644 |
| 第143計算期間末日 | (2019年 3月18日) | 1,090,825,878 | 1,092,819,481 | 8,755 | 8,771 |
| 第144計算期間末日 | (2019年 4月17日) | 1,090,236,984 | 1,092,221,983 | 8,788 | 8,804 |
| 第145計算期間末日 | (2019年 5月17日) | 1,075,079,980 | 1,077,072,242 | 8,634 | 8,650 |
| 第146計算期間末日 | (2019年 6月17日) | 1,081,793,703 | 1,083,786,730 | 8,685 | 8,701 |
| 第147計算期間末日 | (2019年 7月17日) | 1,085,516,226 | 1,087,515,687 | 8,686 | 8,702 |
| 第148計算期間末日 | (2019年 8月19日) | 1,091,070,196 | 1,093,066,099 | 8,746 | 8,762 |
| 第149計算期間末日 | (2019年 9月17日) | 1,088,280,206 | 1,090,270,435 | 8,749 | 8,765 |
| 第150計算期間末日 | (2019年10月17日) | 1,099,048,693 | 1,101,039,754 | 8,832 | 8,848 |
| 第151計算期間末日 | (2019年11月18日) | 1,084,704,508 | 1,086,685,678 | 8,760 | 8,776 |
| 第152計算期間末日 | (2019年12月17日) | 1,094,879,034 | 1,096,861,619 | 8,836 | 8,852 |
| 第153計算期間末日 | (2020年 1月17日) | 1,097,887,270 | 1,099,863,140 | 8,890 | 8,906 |
| 第154計算期間末日 | (2020年 2月17日) | 1,087,716,902 | 1,089,679,730 | 8,867 | 8,883 |
| 第155計算期間末日 | (2020年 3月17日) | 1,055,547,447 | 1,057,477,109 | 8,752 | 8,768 |
| 第156計算期間末日 | (2020年 4月17日) | 1,021,094,748 | 1,022,940,422 | 8,852 | 8,868 |
| 第157計算期間末日 | (2020年 5月18日) | 1,012,084,379 | 1,013,937,223 | 8,740 | 8,756 |
| 第158計算期間末日 | (2020年 6月17日) | 1,035,209,926 | 1,037,064,945 | 8,929 | 8,945 |
| 第159計算期間末日 | (2020年 7月17日) | 1,049,795,335 | 1,051,654,584 | 9,034 | 9,050 |
| 第160計算期間末日 | (2020年 8月17日) | 1,055,424,316 | 1,057,275,996 | 9,120 | 9,136 |

|            |               |               |               |       |       |
|------------|---------------|---------------|---------------|-------|-------|
| 第161計算期間末日 | (2020年 9月17日) | 1,036,682,853 | 1,038,529,211 | 8,984 | 9,000 |
| 第162計算期間末日 | (2020年10月19日) | 1,044,166,853 | 1,046,020,149 | 9,015 | 9,031 |
| 第163計算期間末日 | (2020年11月17日) | 1,032,907,094 | 1,034,757,137 | 8,933 | 8,949 |
| 第164計算期間末日 | (2020年12月17日) | 1,036,491,390 | 1,038,337,990 | 8,981 | 8,997 |
| 第165計算期間末日 | (2021年 1月18日) | 1,022,120,271 | 1,023,955,129 | 8,913 | 8,929 |
| 第166計算期間末日 | (2021年 2月17日) | 1,020,462,806 | 1,022,281,411 | 8,978 | 8,994 |
| 第167計算期間末日 | (2021年 3月17日) | 1,021,735,101 | 1,023,544,676 | 9,034 | 9,050 |
| 第168計算期間末日 | (2021年 4月19日) | 1,012,633,528 | 1,014,435,684 | 8,990 | 9,006 |
| 第169計算期間末日 | (2021年 5月17日) | 1,030,182,534 | 1,032,009,277 | 9,023 | 9,039 |
| 第170計算期間末日 | (2021年 6月17日) | 1,042,855,936 | 1,044,680,971 | 9,143 | 9,159 |
| 第171計算期間末日 | (2021年 7月19日) | 1,037,681,557 | 1,039,510,101 | 9,080 | 9,096 |
| 第172計算期間末日 | (2021年 8月17日) | 1,035,772,621 | 1,037,601,410 | 9,062 | 9,078 |
| 第173計算期間末日 | (2021年 9月17日) | 1,030,017,040 | 1,031,843,583 | 9,023 | 9,039 |
| 第174計算期間末日 | (2021年10月18日) | 1,042,306,918 | 1,044,121,701 | 9,189 | 9,205 |
| 第175計算期間末日 | (2021年11月17日) | 1,022,005,885 | 1,023,798,483 | 9,122 | 9,138 |
| 第176計算期間末日 | (2021年12月17日) | 1,019,953,834 | 1,021,747,830 | 9,097 | 9,113 |
| 第177計算期間末日 | (2022年 1月17日) | 1,002,036,926 | 1,003,825,053 | 8,966 | 8,982 |
| 第178計算期間末日 | (2022年 2月17日) | 982,092,903   | 983,883,023   | 8,778 | 8,794 |
| 第179計算期間末日 | (2022年 3月17日) | 987,389,904   | 989,182,470   | 8,813 | 8,829 |
| 第180計算期間末日 | (2022年 4月18日) | 1,007,281,611 | 1,009,077,752 | 8,973 | 8,989 |
| 第181計算期間末日 | (2022年 5月17日) | 999,105,599   | 1,000,901,615 | 8,901 | 8,917 |
| 第182計算期間末日 | (2022年 6月17日) | 990,369,908   | 992,169,222   | 8,807 | 8,823 |
| 第183計算期間末日 | (2022年 7月19日) | 1,035,928,957 | 1,037,732,803 | 9,189 | 9,205 |
| 第184計算期間末日 | (2022年 8月17日) | 1,019,425,607 | 1,021,231,763 | 9,031 | 9,047 |
| 第185計算期間末日 | (2022年 9月20日) | 1,030,586,361 | 1,032,395,347 | 9,115 | 9,131 |
| 第186計算期間末日 | (2022年10月17日) | 1,015,275,200 | 1,017,087,748 | 8,962 | 8,978 |
| 第187計算期間末日 | (2022年11月17日) | 1,011,357,025 | 1,013,176,104 | 8,896 | 8,912 |
| 第188計算期間末日 | (2022年12月19日) | 998,239,528   | 1,000,058,146 | 8,782 | 8,798 |
| 第189計算期間末日 | (2023年 1月17日) | 956,470,164   | 958,297,000   | 8,377 | 8,393 |
| 第190計算期間末日 | (2023年 2月17日) | 972,527,611   | 974,355,288   | 8,514 | 8,530 |
| 第191計算期間末日 | (2023年 3月17日) | 981,050,479   | 982,883,274   | 8,564 | 8,580 |
| 第192計算期間末日 | (2023年 4月17日) | 996,111,231   | 997,948,097   | 8,677 | 8,693 |
| 第193計算期間末日 | (2023年 5月17日) | 1,013,427,533 | 1,015,269,069 | 8,805 | 8,821 |
| 第194計算期間末日 | (2023年 6月19日) | 1,042,691,164 | 1,044,525,676 | 9,094 | 9,110 |
| 第195計算期間末日 | (2023年 7月18日) | 1,024,351,282 | 1,026,178,532 | 8,970 | 8,986 |
| 第196計算期間末日 | (2023年 8月17日) | 1,044,710,478 | 1,046,537,547 | 9,149 | 9,165 |
| 第197計算期間末日 | (2023年 9月19日) | 1,029,716,207 | 1,031,520,329 | 9,132 | 9,148 |
| 第198計算期間末日 | (2023年10月17日) | 1,018,331,706 | 1,020,128,846 | 9,066 | 9,082 |
| 第199計算期間末日 | (2023年11月17日) | 1,056,049,885 | 1,057,845,878 | 9,408 | 9,424 |
| 第200計算期間末日 | (2023年12月18日) | 1,031,284,860 | 1,033,073,693 | 9,224 | 9,240 |
| 第201計算期間末日 | (2024年 1月17日) | 1,050,717,941 | 1,052,495,022 | 9,460 | 9,476 |
| 第202計算期間末日 | (2024年 2月19日) | 1,044,623,429 | 1,046,382,096 | 9,504 | 9,520 |
| 第203計算期間末日 | (2024年 3月18日) | 1,039,406,043 | 1,041,155,422 | 9,507 | 9,523 |

|            |               |               |               |        |        |
|------------|---------------|---------------|---------------|--------|--------|
| 第204計算期間末日 | (2024年 4月17日) | 1,052,642,208 | 1,054,391,277 | 9,629  | 9,645  |
| 第205計算期間末日 | (2024年 5月17日) | 1,080,289,188 | 1,082,036,754 | 9,891  | 9,907  |
| 第206計算期間末日 | (2024年 6月17日) | 1,075,643,563 | 1,077,365,647 | 9,994  | 10,010 |
| 第207計算期間末日 | (2024年 7月17日) | 1,079,121,942 | 1,080,818,475 | 10,177 | 10,193 |
| 2023年 7月末日 |               | 1,029,015,555 | —             | 9,008  | —      |
| 8月末日       |               | 1,050,227,774 | —             | 9,232  | —      |
| 9月末日       |               | 1,022,520,639 | —             | 9,071  | —      |
| 10月末日      |               | 1,016,657,353 | —             | 9,041  | —      |
| 11月末日      |               | 1,049,678,237 | —             | 9,334  | —      |
| 12月末日      |               | 1,040,107,954 | —             | 9,322  | —      |
| 2024年 1月末日 |               | 1,046,189,555 | —             | 9,465  | —      |
| 2月末日       |               | 1,048,327,599 | —             | 9,566  | —      |
| 3月末日       |               | 1,056,672,506 | —             | 9,665  | —      |
| 4月末日       |               | 1,073,151,729 | —             | 9,822  | —      |
| 5月末日       |               | 1,065,745,571 | —             | 9,853  | —      |
| 6月末日       |               | 1,078,404,070 | —             | 10,174 | —      |
| 7月末日       |               | 1,030,617,244 | —             | 9,777  | —      |

## 【分配の推移】

|          | 1万口当たりの分配金 |
|----------|------------|
| 第88計算期間  | 16円        |
| 第89計算期間  | 16円        |
| 第90計算期間  | 16円        |
| 第91計算期間  | 16円        |
| 第92計算期間  | 16円        |
| 第93計算期間  | 16円        |
| 第94計算期間  | 16円        |
| 第95計算期間  | 16円        |
| 第96計算期間  | 16円        |
| 第97計算期間  | 16円        |
| 第98計算期間  | 16円        |
| 第99計算期間  | 16円        |
| 第100計算期間 | 16円        |
| 第101計算期間 | 16円        |
| 第102計算期間 | 16円        |
| 第103計算期間 | 16円        |
| 第104計算期間 | 16円        |
| 第105計算期間 | 16円        |
| 第106計算期間 | 16円        |
| 第107計算期間 | 16円        |
| 第108計算期間 | 16円        |
| 第109計算期間 | 16円        |
| 第110計算期間 | 16円        |

|          |     |
|----------|-----|
| 第111計算期間 | 16円 |
| 第112計算期間 | 16円 |
| 第113計算期間 | 16円 |
| 第114計算期間 | 16円 |
| 第115計算期間 | 16円 |
| 第116計算期間 | 16円 |
| 第117計算期間 | 16円 |
| 第118計算期間 | 16円 |
| 第119計算期間 | 16円 |
| 第120計算期間 | 16円 |
| 第121計算期間 | 16円 |
| 第122計算期間 | 16円 |
| 第123計算期間 | 16円 |
| 第124計算期間 | 16円 |
| 第125計算期間 | 16円 |
| 第126計算期間 | 16円 |
| 第127計算期間 | 16円 |
| 第128計算期間 | 16円 |
| 第129計算期間 | 16円 |
| 第130計算期間 | 16円 |
| 第131計算期間 | 16円 |
| 第132計算期間 | 16円 |
| 第133計算期間 | 16円 |
| 第134計算期間 | 16円 |
| 第135計算期間 | 16円 |
| 第136計算期間 | 16円 |
| 第137計算期間 | 16円 |
| 第138計算期間 | 16円 |
| 第139計算期間 | 16円 |
| 第140計算期間 | 16円 |
| 第141計算期間 | 16円 |
| 第142計算期間 | 16円 |
| 第143計算期間 | 16円 |
| 第144計算期間 | 16円 |
| 第145計算期間 | 16円 |
| 第146計算期間 | 16円 |
| 第147計算期間 | 16円 |
| 第148計算期間 | 16円 |
| 第149計算期間 | 16円 |
| 第150計算期間 | 16円 |
| 第151計算期間 | 16円 |
| 第152計算期間 | 16円 |
| 第153計算期間 | 16円 |

|          |     |
|----------|-----|
| 第154計算期間 | 16円 |
| 第155計算期間 | 16円 |
| 第156計算期間 | 16円 |
| 第157計算期間 | 16円 |
| 第158計算期間 | 16円 |
| 第159計算期間 | 16円 |
| 第160計算期間 | 16円 |
| 第161計算期間 | 16円 |
| 第162計算期間 | 16円 |
| 第163計算期間 | 16円 |
| 第164計算期間 | 16円 |
| 第165計算期間 | 16円 |
| 第166計算期間 | 16円 |
| 第167計算期間 | 16円 |
| 第168計算期間 | 16円 |
| 第169計算期間 | 16円 |
| 第170計算期間 | 16円 |
| 第171計算期間 | 16円 |
| 第172計算期間 | 16円 |
| 第173計算期間 | 16円 |
| 第174計算期間 | 16円 |
| 第175計算期間 | 16円 |
| 第176計算期間 | 16円 |
| 第177計算期間 | 16円 |
| 第178計算期間 | 16円 |
| 第179計算期間 | 16円 |
| 第180計算期間 | 16円 |
| 第181計算期間 | 16円 |
| 第182計算期間 | 16円 |
| 第183計算期間 | 16円 |
| 第184計算期間 | 16円 |
| 第185計算期間 | 16円 |
| 第186計算期間 | 16円 |
| 第187計算期間 | 16円 |
| 第188計算期間 | 16円 |
| 第189計算期間 | 16円 |
| 第190計算期間 | 16円 |
| 第191計算期間 | 16円 |
| 第192計算期間 | 16円 |
| 第193計算期間 | 16円 |
| 第194計算期間 | 16円 |
| 第195計算期間 | 16円 |
| 第196計算期間 | 16円 |

|          |     |
|----------|-----|
| 第197計算期間 | 16円 |
| 第198計算期間 | 16円 |
| 第199計算期間 | 16円 |
| 第200計算期間 | 16円 |
| 第201計算期間 | 16円 |
| 第202計算期間 | 16円 |
| 第203計算期間 | 16円 |
| 第204計算期間 | 16円 |
| 第205計算期間 | 16円 |
| 第206計算期間 | 16円 |
| 第207計算期間 | 16円 |

## 【収益率の推移】

|          | 収益率（％） |
|----------|--------|
| 第88計算期間  | 1.44   |
| 第89計算期間  | 2.17   |
| 第90計算期間  | 0.07   |
| 第91計算期間  | 8.11   |
| 第92計算期間  | 1.45   |
| 第93計算期間  | 1.68   |
| 第94計算期間  | 0.35   |
| 第95計算期間  | 0.32   |
| 第96計算期間  | 0.08   |
| 第97計算期間  | 1.16   |
| 第98計算期間  | 0.63   |
| 第99計算期間  | 0.54   |
| 第100計算期間 | 1.96   |
| 第101計算期間 | 3.19   |
| 第102計算期間 | 0.73   |
| 第103計算期間 | 0.40   |
| 第104計算期間 | 0.32   |
| 第105計算期間 | 3.86   |
| 第106計算期間 | 0.13   |
| 第107計算期間 | 0.80   |
| 第108計算期間 | 2.91   |
| 第109計算期間 | 0.76   |
| 第110計算期間 | 2.94   |
| 第111計算期間 | 0.85   |
| 第112計算期間 | 3.70   |
| 第113計算期間 | 0.30   |
| 第114計算期間 | 0.45   |
| 第115計算期間 | 0.70   |
| 第116計算期間 | 6.21   |

|          |      |
|----------|------|
| 第117計算期間 | 1.95 |
| 第118計算期間 | 0.46 |
| 第119計算期間 | 0.04 |
| 第120計算期間 | 3.55 |
| 第121計算期間 | 5.63 |
| 第122計算期間 | 0.14 |
| 第123計算期間 | 1.62 |
| 第124計算期間 | 0.40 |
| 第125計算期間 | 2.23 |
| 第126計算期間 | 0.16 |
| 第127計算期間 | 0.54 |
| 第128計算期間 | 0.32 |
| 第129計算期間 | 0.65 |
| 第130計算期間 | 4.12 |
| 第131計算期間 | 0.45 |
| 第132計算期間 | 2.10 |
| 第133計算期間 | 0.78 |
| 第134計算期間 | 0.34 |
| 第135計算期間 | 2.68 |
| 第136計算期間 | 3.24 |
| 第137計算期間 | 1.69 |
| 第138計算期間 | 0.69 |
| 第139計算期間 | 0.13 |
| 第140計算期間 | 1.39 |
| 第141計算期間 | 2.71 |
| 第142計算期間 | 1.68 |
| 第143計算期間 | 1.65 |
| 第144計算期間 | 0.55 |
| 第145計算期間 | 1.57 |
| 第146計算期間 | 0.77 |
| 第147計算期間 | 0.19 |
| 第148計算期間 | 0.87 |
| 第149計算期間 | 0.21 |
| 第150計算期間 | 1.13 |
| 第151計算期間 | 0.63 |
| 第152計算期間 | 1.05 |
| 第153計算期間 | 0.79 |
| 第154計算期間 | 0.07 |
| 第155計算期間 | 1.11 |
| 第156計算期間 | 1.32 |
| 第157計算期間 | 1.08 |
| 第158計算期間 | 2.34 |
| 第159計算期間 | 1.35 |

|          |      |
|----------|------|
| 第160計算期間 | 1.12 |
| 第161計算期間 | 1.31 |
| 第162計算期間 | 0.52 |
| 第163計算期間 | 0.73 |
| 第164計算期間 | 0.71 |
| 第165計算期間 | 0.57 |
| 第166計算期間 | 0.90 |
| 第167計算期間 | 0.80 |
| 第168計算期間 | 0.30 |
| 第169計算期間 | 0.54 |
| 第170計算期間 | 1.50 |
| 第171計算期間 | 0.51 |
| 第172計算期間 | 0.02 |
| 第173計算期間 | 0.25 |
| 第174計算期間 | 2.01 |
| 第175計算期間 | 0.55 |
| 第176計算期間 | 0.09 |
| 第177計算期間 | 1.26 |
| 第178計算期間 | 1.91 |
| 第179計算期間 | 0.58 |
| 第180計算期間 | 1.99 |
| 第181計算期間 | 0.62 |
| 第182計算期間 | 0.87 |
| 第183計算期間 | 4.51 |
| 第184計算期間 | 1.54 |
| 第185計算期間 | 1.10 |
| 第186計算期間 | 1.50 |
| 第187計算期間 | 0.55 |
| 第188計算期間 | 1.10 |
| 第189計算期間 | 4.42 |
| 第190計算期間 | 1.82 |
| 第191計算期間 | 0.77 |
| 第192計算期間 | 1.50 |
| 第193計算期間 | 1.65 |
| 第194計算期間 | 3.46 |
| 第195計算期間 | 1.18 |
| 第196計算期間 | 2.17 |
| 第197計算期間 | 0.01 |
| 第198計算期間 | 0.54 |
| 第199計算期間 | 3.94 |
| 第200計算期間 | 1.78 |
| 第201計算期間 | 2.73 |
| 第202計算期間 | 0.63 |

|          |      |
|----------|------|
| 第203計算期間 | 0.19 |
| 第204計算期間 | 1.45 |
| 第205計算期間 | 2.88 |
| 第206計算期間 | 1.20 |
| 第207計算期間 | 1.99 |

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

|          |            |            |               |
|----------|------------|------------|---------------|
| 第122計算期間 | 7,122,026  | 14,520,078 | 1,290,377,565 |
| 第123計算期間 | 7,455,512  | 10,518,307 | 1,287,314,770 |
| 第124計算期間 | 10,726,404 | 7,946,645  | 1,290,094,529 |
| 第125計算期間 | 8,628,402  | 11,549,265 | 1,287,173,666 |
| 第126計算期間 | 8,158,726  | 27,400,712 | 1,267,931,680 |
| 第127計算期間 | 7,540,002  | 19,818,575 | 1,255,653,107 |
| 第128計算期間 | 7,248,128  | 10,502,722 | 1,252,398,513 |
| 第129計算期間 | 8,269,080  | 6,534,976  | 1,254,132,617 |
| 第130計算期間 | 8,524,551  | 9,644,891  | 1,253,012,277 |
| 第131計算期間 | 19,182,341 | 8,506,501  | 1,263,688,117 |
| 第132計算期間 | 7,428,472  | 4,169,341  | 1,266,947,248 |
| 第133計算期間 | 9,823,237  | 9,779,277  | 1,266,991,208 |
| 第134計算期間 | 9,064,956  | 21,369,731 | 1,254,686,433 |
| 第135計算期間 | 7,282,582  | 5,110,507  | 1,256,858,508 |
| 第136計算期間 | 8,567,784  | 9,607,255  | 1,255,819,037 |
| 第137計算期間 | 6,874,612  | 5,021,525  | 1,257,672,124 |
| 第138計算期間 | 7,204,937  | 16,649,302 | 1,248,227,759 |
| 第139計算期間 | 6,997,281  | 11,421,711 | 1,243,803,329 |
| 第140計算期間 | 6,674,673  | 4,769,826  | 1,245,708,176 |
| 第141計算期間 | 8,580,699  | 8,346,142  | 1,245,942,733 |
| 第142計算期間 | 5,737,972  | 1,658,122  | 1,250,022,583 |
| 第143計算期間 | 5,842,387  | 9,862,638  | 1,246,002,332 |
| 第144計算期間 | 5,592,836  | 10,970,721 | 1,240,624,447 |
| 第145計算期間 | 6,081,750  | 1,542,257  | 1,245,163,940 |
| 第146計算期間 | 5,597,085  | 5,118,619  | 1,245,642,406 |
| 第147計算期間 | 9,936,768  | 5,915,863  | 1,249,663,311 |
| 第148計算期間 | 6,627,176  | 8,851,005  | 1,247,439,482 |
| 第149計算期間 | 5,384,398  | 8,930,636  | 1,243,893,244 |
| 第150計算期間 | 10,252,766 | 9,732,681  | 1,244,413,329 |
| 第151計算期間 | 10,195,905 | 16,377,939 | 1,238,231,295 |
| 第152計算期間 | 6,636,173  | 5,751,426  | 1,239,116,042 |
| 第153計算期間 | 6,475,063  | 10,672,110 | 1,234,918,995 |
| 第154計算期間 | 5,267,961  | 13,418,989 | 1,226,767,967 |
| 第155計算期間 | 6,425,298  | 27,154,194 | 1,206,039,071 |
| 第156計算期間 | 8,726,336  | 61,218,609 | 1,153,546,798 |
| 第157計算期間 | 6,269,357  | 1,788,202  | 1,158,027,953 |
| 第158計算期間 | 6,301,465  | 4,941,994  | 1,159,387,424 |
| 第159計算期間 | 5,856,451  | 3,213,136  | 1,162,030,739 |
| 第160計算期間 | 5,210,412  | 9,940,848  | 1,157,300,303 |
| 第161計算期間 | 5,780,351  | 9,106,513  | 1,153,974,141 |
| 第162計算期間 | 10,838,509 | 6,502,124  | 1,158,310,526 |
| 第163計算期間 | 13,240,940 | 15,274,212 | 1,156,277,254 |
| 第164計算期間 | 6,313,553  | 8,465,372  | 1,154,125,435 |

|          |            |            |               |
|----------|------------|------------|---------------|
| 第165計算期間 | 6,447,516  | 13,786,128 | 1,146,786,823 |
| 第166計算期間 | 7,791,111  | 17,949,658 | 1,136,628,276 |
| 第167計算期間 | 7,030,605  | 12,674,369 | 1,130,984,512 |
| 第168計算期間 | 6,872,066  | 11,508,861 | 1,126,347,717 |
| 第169計算期間 | 22,450,207 | 7,083,335  | 1,141,714,589 |
| 第170計算期間 | 6,495,984  | 7,563,334  | 1,140,647,239 |
| 第171計算期間 | 7,388,193  | 5,195,047  | 1,142,840,385 |
| 第172計算期間 | 5,972,634  | 5,819,835  | 1,142,993,184 |
| 第173計算期間 | 6,259,416  | 7,662,659  | 1,141,589,941 |
| 第174計算期間 | 5,488,668  | 12,838,975 | 1,134,239,634 |
| 第175計算期間 | 5,287,328  | 19,152,588 | 1,120,374,374 |
| 第176計算期間 | 6,682,081  | 5,808,520  | 1,121,247,935 |
| 第177計算期間 | 5,100,051  | 8,768,285  | 1,117,579,701 |
| 第178計算期間 | 5,716,338  | 4,470,876  | 1,118,825,163 |
| 第179計算期間 | 4,920,253  | 3,391,148  | 1,120,354,268 |
| 第180計算期間 | 4,714,120  | 2,479,876  | 1,122,588,512 |
| 第181計算期間 | 4,897,296  | 4,975,532  | 1,122,510,276 |
| 第182計算期間 | 5,514,173  | 3,452,588  | 1,124,571,861 |
| 第183計算期間 | 4,659,434  | 1,827,404  | 1,127,403,891 |
| 第184計算期間 | 4,665,402  | 3,221,215  | 1,128,848,078 |
| 第185計算期間 | 4,898,434  | 3,129,979  | 1,130,616,533 |
| 第186計算期間 | 4,438,903  | 2,212,422  | 1,132,843,014 |
| 第187計算期間 | 4,896,986  | 815,140    | 1,136,924,860 |
| 第188計算期間 | 5,555,471  | 5,843,530  | 1,136,636,801 |
| 第189計算期間 | 5,768,678  | 632,735    | 1,141,772,744 |
| 第190計算期間 | 4,963,163  | 4,437,333  | 1,142,298,574 |
| 第191計算期間 | 5,625,767  | 2,426,922  | 1,145,497,419 |
| 第192計算期間 | 5,044,995  | 2,500,636  | 1,148,041,778 |
| 第193計算期間 | 5,057,509  | 2,139,029  | 1,150,960,258 |
| 第194計算期間 | 5,082,105  | 9,471,830  | 1,146,570,533 |
| 第195計算期間 | 5,293,410  | 9,832,563  | 1,142,031,380 |
| 第196計算期間 | 5,450,400  | 5,563,339  | 1,141,918,441 |
| 第197計算期間 | 4,969,249  | 19,311,363 | 1,127,576,327 |
| 第198計算期間 | 5,005,727  | 9,368,937  | 1,123,213,117 |
| 第199計算期間 | 4,638,448  | 5,355,789  | 1,122,495,776 |
| 第200計算期間 | 5,380,413  | 9,855,047  | 1,118,021,142 |
| 第201計算期間 | 5,028,771  | 12,374,105 | 1,110,675,808 |
| 第202計算期間 | 3,658,042  | 15,166,600 | 1,099,167,250 |
| 第203計算期間 | 3,965,897  | 9,770,918  | 1,093,362,229 |
| 第204計算期間 | 3,850,084  | 4,043,703  | 1,093,168,610 |
| 第205計算期間 | 3,591,934  | 4,531,517  | 1,092,229,027 |
| 第206計算期間 | 3,645,580  | 19,572,035 | 1,076,302,572 |
| 第207計算期間 | 3,468,623  | 19,437,461 | 1,060,333,734 |

（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 7月31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     | 301,472,073,180 | 46.05   |
|                          | 中国       | 65,912,051,632  | 10.07   |
|                          | フランス     | 49,227,851,314  | 7.52    |
|                          | イタリア     | 45,896,925,032  | 7.01    |
|                          | ドイツ      | 38,954,600,194  | 5.95    |
|                          | イギリス     | 34,020,034,204  | 5.20    |
|                          | スペイン     | 31,221,979,195  | 4.77    |
|                          | カナダ      | 12,580,639,008  | 1.92    |
|                          | ベルギー     | 10,576,947,038  | 1.62    |
|                          | オランダ     | 9,619,952,275   | 1.47    |
|                          | オーストラリア  | 8,066,160,933   | 1.23    |
|                          | オーストリア   | 7,502,965,629   | 1.15    |
|                          | メキシコ     | 4,860,639,138   | 0.74    |
|                          | ポーランド    | 3,516,151,366   | 0.54    |
|                          | フィンランド   | 3,512,068,087   | 0.54    |
|                          | マレーシア    | 3,235,368,326   | 0.49    |
|                          | アイルランド   | 3,160,231,761   | 0.48    |
|                          | シンガポール   | 2,558,194,056   | 0.39    |
|                          | イスラエル    | 2,044,710,980   | 0.31    |
|                          | デンマーク    | 1,600,187,295   | 0.24    |
|                          | ニュージーランド | 1,550,969,037   | 0.24    |
|                          | スウェーデン   | 1,007,199,509   | 0.15    |
|                          | ノルウェー    | 988,398,818     | 0.15    |
| 小計                       |          | 643,086,298,007 | 98.22   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —        | 11,635,393,189  | 1.78    |
| 純資産総額                    |          | 654,721,691,196 | 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 7月31日現在

| 国／地域 | 種類   | 銘柄名             | 数量         | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(％) | 償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率<br>(％) |
|------|------|-----------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|-----------------|-----------------|
| アメリカ | 国債証券 | 4 T-NOTE 340215 | 25,750,000 | 14,640.68       | 3,769,975,834   | 15,071.31       | 3,880,863,390   | 4.000000  | 2034/2/15       | 0.59            |

|      |      |                        |            |           |               |           |               |          |            |      |
|------|------|------------------------|------------|-----------|---------------|-----------|---------------|----------|------------|------|
| アメリカ | 国債証券 | 4.5 T-NOTE 331115      | 19,430,000 | 15,228.51 | 2,958,901,019 | 15,662.01 | 3,043,130,317 | 4.500000 | 2033/11/15 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | 4.625 T-NOTE 260228    | 19,800,000 | 15,166.88 | 3,003,043,595 | 15,266.33 | 3,022,733,343 | 4.625000 | 2026/2/28  | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | 0.875 T-NOTE 301115    | 22,310,000 | 12,171.38 | 2,715,435,156 | 12,580.46 | 2,806,702,481 | 0.875000 | 2030/11/15 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | 3.875 T-NOTE 330815    | 18,320,000 | 14,513.65 | 2,658,902,056 | 14,940.01 | 2,737,010,407 | 3.875000 | 2033/8/15  | 0.42 |
| アメリカ | 国債証券 | 2.375 T-NOTE 270515    | 18,570,000 | 14,281.53 | 2,652,080,505 | 14,515.14 | 2,695,462,658 | 2.375000 | 2027/5/15  | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | 3.5 T-NOTE 330215      | 17,690,000 | 14,137.32 | 2,500,892,130 | 14,557.72 | 2,575,261,070 | 3.500000 | 2033/2/15  | 0.39 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.375 T-NOTE 311115    | 20,320,000 | 12,239.26 | 2,487,018,566 | 12,652.22 | 2,570,931,568 | 1.375000 | 2031/11/15 | 0.39 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.25 T-NOTE 310815     | 19,990,000 | 12,214.85 | 2,441,748,600 | 12,623.04 | 2,523,346,566 | 1.250000 | 2031/8/15  | 0.39 |
| アメリカ | 国債証券 | 4.125 T-NOTE 321115    | 16,070,000 | 14,833.12 | 2,383,683,449 | 15,263.35 | 2,452,820,780 | 4.125000 | 2032/11/15 | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | 3.375 T-NOTE 330515    | 16,800,000 | 13,970.68 | 2,347,075,798 | 14,399.32 | 2,419,087,021 | 3.375000 | 2033/5/15  | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | 2.75 T-NOTE 320815     | 17,340,000 | 13,410.25 | 2,325,338,036 | 13,835.71 | 2,399,113,229 | 2.750000 | 2032/8/15  | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | 2.875 T-NOTE 320515    | 17,030,000 | 13,581.45 | 2,312,921,147 | 14,004.82 | 2,385,022,474 | 2.875000 | 2032/5/15  | 0.36 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.625 T-NOTE 310515    | 17,540,000 | 12,651.66 | 2,219,102,293 | 13,050.59 | 2,289,073,631 | 1.625000 | 2031/5/15  | 0.35 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.875 T-NOTE 320215    | 16,860,000 | 12,643.88 | 2,131,759,119 | 13,060.41 | 2,201,986,146 | 1.875000 | 2032/2/15  | 0.34 |
| アメリカ | 国債証券 | 4.625 T-NOTE 290430    | 14,050,000 | 15,429.34 | 2,167,822,967 | 15,618.25 | 2,194,364,417 | 4.625000 | 2029/4/30  | 0.34 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.125 T-NOTE 310215    | 17,120,000 | 12,311.91 | 2,107,799,313 | 12,712.96 | 2,176,458,754 | 1.125000 | 2031/2/15  | 0.33 |
| アメリカ | 国債証券 | 0.625 T-NOTE 300815    | 17,350,000 | 12,045.73 | 2,089,935,420 | 12,463.16 | 2,162,358,408 | 0.625000 | 2030/8/15  | 0.33 |
| アメリカ | 国債証券 | 3.125 T-NOTE 281115    | 14,380,000 | 14,370.10 | 2,066,421,018 | 14,673.54 | 2,110,055,175 | 3.125000 | 2028/11/15 | 0.32 |
| アメリカ | 国債証券 | 4.25 T-NOTE 251231     | 13,580,000 | 15,071.31 | 2,046,684,457 | 15,173.43 | 2,060,552,730 | 4.250000 | 2025/12/31 | 0.31 |
| アメリカ | 国債証券 | 4.25 T-NOTE 260131     | 13,390,000 | 15,098.65 | 2,021,710,395 | 15,177.30 | 2,032,241,474 | 4.250000 | 2026/1/31  | 0.31 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.125 T-NOTE 280831    | 14,930,000 | 13,218.33 | 1,973,497,696 | 13,560.31 | 2,024,554,593 | 1.125000 | 2028/8/31  | 0.31 |
| アメリカ | 国債証券 | 4.5 T-NOTE 270415      | 13,000,000 | 15,170.16 | 1,972,121,044 | 15,351.77 | 1,995,731,375 | 4.500000 | 2027/4/15  | 0.30 |
| アメリカ | 国債証券 | 4.25 T-BOND 540215     | 13,340,000 | 14,275.31 | 1,904,327,055 | 14,853.37 | 1,981,439,890 | 4.250000 | 2054/2/15  | 0.30 |
| アメリカ | 国債証券 | 0.75 T-NOTE 260331     | 13,590,000 | 14,123.03 | 1,919,319,779 | 14,337.99 | 1,948,533,432 | 0.750000 | 2026/3/31  | 0.30 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.5 T-NOTE 270131      | 13,540,000 | 14,006.91 | 1,896,536,119 | 14,261.47 | 1,931,003,937 | 1.500000 | 2027/1/31  | 0.29 |
| アメリカ | 国債証券 | 4.5 T-NOTE 270515      | 12,500,000 | 15,226.46 | 1,903,308,675 | 15,360.11 | 1,920,014,555 | 4.500000 | 2027/5/15  | 0.29 |
| 中国   | 国債証券 | 2.39 CHINA GOVT 261115 | 88,000,000 | 2,126.65  | 1,871,456,955 | 2,137.48  | 1,880,988,525 | 2.390000 | 2026/11/15 | 0.29 |
| アメリカ | 国債証券 | 4 T-NOTE 270115        | 12,300,000 | 14,970.67 | 1,841,393,616 | 15,149.91 | 1,863,439,650 | 4.000000 | 2027/1/15  | 0.28 |
| アメリカ | 国債証券 | 4.125 T-NOTE 310331    | 12,100,000 | 14,905.76 | 1,803,598,053 | 15,294.61 | 1,850,648,390 | 4.125000 | 2031/3/31  | 0.28 |

（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 7月31日現在

| 種類   | 投資比率（％） |
|------|---------|
| 国債証券 | 98.22   |
| 合計   | 98.22   |

（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。

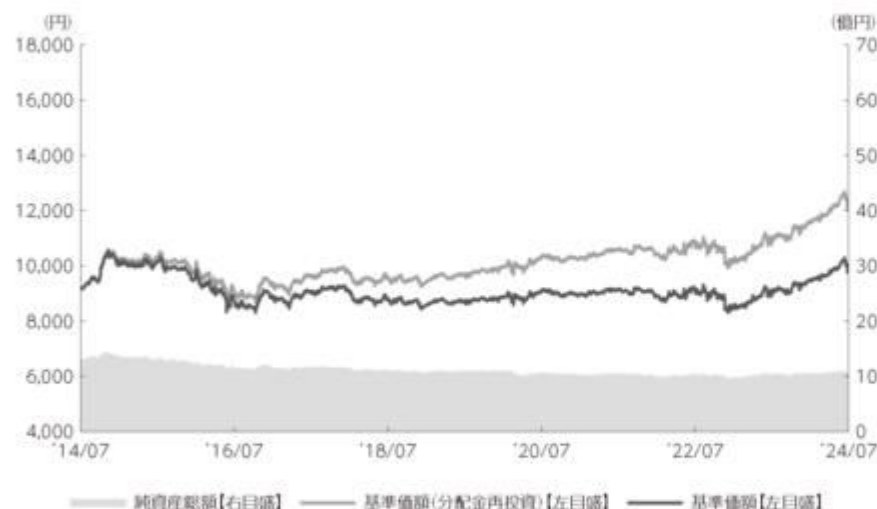
## 参考情報



## 運用実績

2024年7月31日現在

### ■基準価額・純資産の推移 2014年7月31日～2024年7月31日



### ■基準価額・純資産

|       |        |
|-------|--------|
| 基準価額  | 9,777円 |
| 純資産総額 | 10.3億円 |

●純資産総額は表示桁未満切捨て

### ■分配の推移

|          |        |
|----------|--------|
| 2024年 7月 | 16円    |
| 2024年 6月 | 16円    |
| 2024年 5月 | 16円    |
| 2024年 4月 | 16円    |
| 2024年 3月 | 16円    |
| 2024年 2月 | 16円    |
| 直近1年間累計  | 192円   |
| 設定来累計    | 3,795円 |

●分配金は1万口当たり、税引前

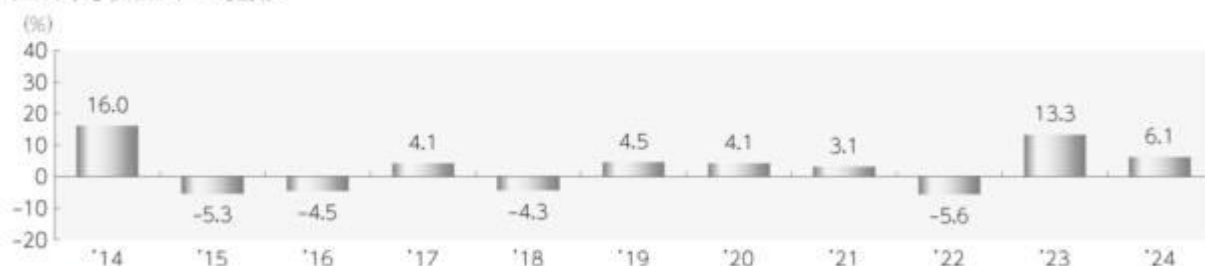
### ■主要な資産の状況

| 組入上位通貨       | 比率    | 組入上位銘柄                 | 種別 | 国・地域 | 比率   |
|--------------|-------|------------------------|----|------|------|
| 1 アメリカドル     | 47.1% | 1 4 T-NOTE 340215      | 国債 | アメリカ | 0.6% |
| 2 ユーロ        | 30.9% | 2 4.5 T-NOTE 331115    | 国債 | アメリカ | 0.5% |
| 3 中国元        | 10.2% | 3 4.625 T-NOTE 260228  | 国債 | アメリカ | 0.5% |
| 4 イギリスポンド    | 5.3%  | 4 0.875 T-NOTE 301115  | 国債 | アメリカ | 0.4% |
| 5 カナダドル      | 2.0%  | 5 3.875 T-NOTE 330815  | 国債 | アメリカ | 0.4% |
| 6 オーストラリアドル  | 1.3%  | 6 2.375 T-NOTE 270515  | 国債 | アメリカ | 0.4% |
| 7 メキシコペソ     | 0.8%  | 7 3.5 T-NOTE 330215    | 国債 | アメリカ | 0.4% |
| 8 ポーランドズロチ   | 0.6%  | 8 1.375 T-NOTE 311115  | 国債 | アメリカ | 0.4% |
| 9 マレーシアリンギット | 0.5%  | 9 1.25 T-NOTE 310815   | 国債 | アメリカ | 0.4% |
| 10 シンガポールドル  | 0.4%  | 10 4.125 T-NOTE 321115 | 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)

●「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



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。

## 1【申込（販売）手続等】

### <訂正前>

#### 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。

#### 申込単位

販売会社が定める単位

#### 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

#### 申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

#### 申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認ください。

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/>

#### 申込手数料

ありません。

#### 申込方法

取得申込者は、販売会社取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

なお、申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があります。申込みコースの取扱いには販売会社により異なる場合があります。

#### 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。

#### 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>

#### 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。

#### 申込単位

## 販売会社が定める単位

### 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

### 申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

### 申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認ください。

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/>

### 申込手数料

ありません。

### 申込方法

取得申込者は、販売会社取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

なお、申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があります。申込みコースの取扱いには販売会社により異なる場合があります。

### 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。

### 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>

#### 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。

解約単位

販売会社が定める単位

解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

信託財産留保額

ありません。

解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

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。

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。

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およびすでに受け付けた解約請求を取り消すことがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとします。

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

< 訂正後 >

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。

解約単位

販売会社が定める単位

解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

信託財産留保額

ありません。

### 解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

### 解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ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/>

### 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。

### 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。

### 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およびすでに受け付けた解約請求を取り消すことがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとします。

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

## 第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

- 3 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（2024年1月18日から2024年7月17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】

## 【三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 前期<br>[ 2024年 1月17日現在 ] | 当期<br>[ 2024年 7月17日現在 ] |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| 資産の部            |                         |                         |
| 流動資産            |                         |                         |
| コール・ローン         | 1,077,864               | 1,378,184               |
| 親投資信託受益証券       | 1,050,398,699           | 1,078,794,081           |
| 未収入金            | 2,753,166               | 1,484,332               |
| 未収利息            | -                       | 2                       |
| 流動資産合計          | 1,054,229,729           | 1,081,656,599           |
| 資産合計            | 1,054,229,729           | 1,081,656,599           |
| 負債の部            |                         |                         |
| 流動負債            |                         |                         |
| 未払収益分配金         | 1,777,081               | 1,696,533               |
| 未払解約金           | 1,026,356               | 100,101                 |
| 未払受託者報酬         | 46,961                  | 48,930                  |
| 未払委託者報酬         | 657,454                 | 684,991                 |
| その他未払費用         | 3,936                   | 4,102                   |
| 流動負債合計          | 3,511,788               | 2,534,657               |
| 負債合計            | 3,511,788               | 2,534,657               |
| 純資産の部           |                         |                         |
| 元本等             |                         |                         |
| 元本              | 1,110,675,808           | 1,060,333,734           |
| 剰余金             |                         |                         |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 59,957,867              | 18,788,208              |
| （分配準備積立金）       | 67,999,616              | 137,670,972             |
| 元本等合計           | 1,050,717,941           | 1,079,121,942           |
| 純資産合計           | 1,050,717,941           | 1,079,121,942           |
| 負債純資産合計         | 1,054,229,729           | 1,081,656,599           |

## (2)【損益及び剰余金計算書】

|                                           | 前期<br>自 2023年 7月19日<br>至 2024年 1月17日 | 当期<br>自 2024年 1月18日<br>至 2024年 7月17日 |
|-------------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                      |                                      |
| 受取利息                                      | 1                                    | 77                                   |
| 有価証券売買等損益                                 | 70,403,632                           | 92,834,260                           |
| 営業収益合計                                    | 70,403,633                           | 92,834,337                           |
| 営業費用                                      |                                      |                                      |
| 支払利息                                      | 69                                   | -                                    |
| 受託者報酬                                     | 284,693                              | 290,911                              |
| 委託者報酬                                     | 3,985,671                            | 4,072,795                            |
| その他費用                                     | 23,854                               | 24,379                               |
| 営業費用合計                                    | 4,294,287                            | 4,388,085                            |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             | 66,109,346                           | 88,446,252                           |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             | 66,109,346                           | 88,446,252                           |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）                           | 66,109,346                           | 88,446,252                           |
| 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（ ） | 164,615                              | 545,589                              |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           | 117,680,098                          | 59,957,867                           |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 5,073,762                            | 1,935,852                            |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 5,073,762                            | 1,896,716                            |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | -                                    | 39,136                               |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 2,506,024                            | 667,142                              |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 2,506,024                            | 667,142                              |
| 分配金                                       | 10,790,238                           | 10,423,298                           |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）                           | 59,957,867                           | 18,788,208                           |

## （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<br>[2024年 1月17日現在] | 当期<br>[2024年 7月17日現在] |
|-----------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 1. 期首元本額                    | 1,142,031,380円        | 1,110,675,808円        |
| 期中追加設定元本額                   | 30,473,008円           | 22,180,160円           |
| 期中一部解約元本額                   | 61,828,580円           | 72,522,234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。 | 59,957,867円           | —円                    |
| 3. 受益権の総数                   | 1,110,675,808口        | 1,060,333,734口        |

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

（損益及利益金計算書に關する注記）

| 前期<br>自 2023年 7月19日<br>至 2024年 1月17日                                                                                                                                                                                                                                                            | 当期<br>自 2024年 1月18日<br>至 2024年 7月17日               |              |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |              |          |   |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |    |  |  |              |   |            |                           |   |            |        |   |              |          |   |             |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------|--------------|--|--------------|---|------------|---------------------------|---|----|--------|---|--------------|----------|---|-------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|--|--|--------------|---|------------|---------------------------|---|------------|--------|---|--------------|----------|---|-------------|
| 1. 分配金の計算過程<br>第196期<br>2023年 7月19日<br>2023年 8月17日                                                                                                                                                                                                                                              | 1. 分配金の計算過程<br>第202期<br>2024年 1月18日<br>2024年 2月19日 |              |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |              |          |   |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |    |  |  |              |   |            |                           |   |            |        |   |              |          |   |             |
| <table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>2,018,853円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>—円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>113,480,289円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>71,641,891円</td></tr></table> | 項目                                                 |              |  | 費用控除後の配当等収益額 | A | 2,018,853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 | 113,480,289円 | 分配準備積立金額 | D | 71,641,891円 | <table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>2,149,952円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>2,905,423円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>110,987,108円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>67,073,022円</td></tr></table> | 項目 |  |  | 費用控除後の配当等収益額 | A | 2,149,952円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 2,905,423円 | 収益調整金額 | C | 110,987,108円 | 分配準備積立金額 | D | 67,073,022円 |
| 項目                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                                                    |              |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |              |          |   |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |    |  |  |              |   |            |                           |   |            |        |   |              |          |   |             |
| 費用控除後の配当等収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                    | A                                                  | 2,018,853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                                                  | 113,480,289円 |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |              |          |   |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |    |  |  |              |   |            |                           |   |            |        |   |              |          |   |             |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                        | D                                                  | 71,641,891円  |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |              |          |   |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |    |  |  |              |   |            |                           |   |            |        |   |              |          |   |             |
| 項目                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                                                    |              |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |              |          |   |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |    |  |  |              |   |            |                           |   |            |        |   |              |          |   |             |
| 費用控除後の配当等収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                    | A                                                  | 2,149,952円   |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |              |          |   |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |    |  |  |              |   |            |                           |   |            |        |   |              |          |   |             |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額                                                                                                                                                                                                                                                                       | B                                                  | 2,905,423円   |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |              |          |   |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |    |  |  |              |   |            |                           |   |            |        |   |              |          |   |             |
| 収益調整金額                                                                                                                                                                                                                                                                                          | C                                                  | 110,987,108円 |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |              |          |   |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |    |  |  |              |   |            |                           |   |            |        |   |              |          |   |             |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                        | D                                                  | 67,073,022円  |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |              |          |   |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |    |  |  |              |   |            |                           |   |            |        |   |              |          |   |             |

| 前期<br>自 2023年 7月19日<br>至 2024年 1月17日 |              |                | 当期<br>自 2024年 1月18日<br>至 2024年 7月17日 |              |                |
|--------------------------------------|--------------|----------------|--------------------------------------|--------------|----------------|
| 当ファンドの分配対象収益額                        | E=A+B+C+D    | 187,141,033円   | 当ファンドの分配対象収益額                        | E=A+B+C+D    | 183,115,505円   |
| 当ファンドの期末残存口数                         | F            | 1,141,918,441口 | 当ファンドの期末残存口数                         | F            | 1,099,167,250口 |
| 1万口当たり収益分配対象額                        | G=E/F*10,000 | 1,638円         | 1万口当たり収益分配対象額                        | G=E/F*10,000 | 1,665円         |
| 1万口当たり分配金額                           | H            | 16円            | 1万口当たり分配金額                           | H            | 16円            |
| 収益分配金金額                              | I=F*H/10,000 | 1,827,069円     | 収益分配金金額                              | I=F*H/10,000 | 1,758,667円     |
| 第197期<br>2023年 8月18日<br>2023年 9月19日  |              |                | 第203期<br>2024年 2月20日<br>2024年 3月18日  |              |                |
| 項目                                   |              |                | 項目                                   |              |                |
| 費用控除後の配当等収益額                         | A            | 1,528,530円     | 費用控除後の配当等収益額                         | A            | 1,579,637円     |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額            | B            | —円             | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額            | B            | 457,948円       |
| 収益調整金額                               | C            | 112,367,812円   | 収益調整金額                               | C            | 110,654,769円   |
| 分配準備積立金額                             | D            | 70,621,642円    | 分配準備積立金額                             | D            | 69,745,376円    |
| 当ファンドの分配対象収益額                        | E=A+B+C+D    | 184,517,984円   | 当ファンドの分配対象収益額                        | E=A+B+C+D    | 182,437,730円   |
| 当ファンドの期末残存口数                         | F            | 1,127,576,327口 | 当ファンドの期末残存口数                         | F            | 1,093,362,229口 |
| 1万口当たり収益分配対象額                        | G=E/F*10,000 | 1,636円         | 1万口当たり収益分配対象額                        | G=E/F*10,000 | 1,668円         |
| 1万口当たり分配金額                           | H            | 16円            | 1万口当たり分配金額                           | H            | 16円            |
| 収益分配金金額                              | I=F*H/10,000 | 1,804,122円     | 収益分配金金額                              | I=F*H/10,000 | 1,749,379円     |
| 第198期<br>2023年 9月20日<br>2023年10月17日  |              |                | 第204期<br>2024年 3月19日<br>2024年 4月17日  |              |                |
| 項目                                   |              |                | 項目                                   |              |                |
| 費用控除後の配当等収益額                         | A            | 1,337,471円     | 費用控除後の配当等収益額                         | A            | 2,179,349円     |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額            | B            | —円             | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額            | B            | 12,956,523円    |
| 収益調整金額                               | C            | 112,247,815円   | 収益調整金額                               | C            | 110,884,718円   |
| 分配準備積立金額                             | D            | 69,763,300円    | 分配準備積立金額                             | D            | 69,775,037円    |
| 当ファンドの分配対象収益額                        | E=A+B+C+D    | 183,348,586円   | 当ファンドの分配対象収益額                        | E=A+B+C+D    | 195,795,627円   |
| 当ファンドの期末残存口数                         | F            | 1,123,213,117口 | 当ファンドの期末残存口数                         | F            | 1,093,168,610口 |
| 1万口当たり収益分配対象額                        | G=E/F*10,000 | 1,632円         | 1万口当たり収益分配対象額                        | G=E/F*10,000 | 1,791円         |
| 1万口当たり分配金額                           | H            | 16円            | 1万口当たり分配金額                           | H            | 16円            |
| 収益分配金金額                              | I=F*H/10,000 | 1,797,140円     | 収益分配金金額                              | I=F*H/10,000 | 1,749,069円     |
| 第199期<br>2023年10月18日<br>2023年11月17日  |              |                | 第205期<br>2024年 4月18日<br>2024年 5月17日  |              |                |
| 項目                                   |              |                | 項目                                   |              |                |
| 費用控除後の配当等収益額                         | A            | 2,201,944円     | 費用控除後の配当等収益額                         | A            | 2,316,337円     |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額            | B            | —円             | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額            | B            | 27,948,848円    |
| 収益調整金額                               | C            | 112,464,585円   | 収益調整金額                               | C            | 111,063,615円   |
| 分配準備積立金額                             | D            | 68,974,012円    | 分配準備積立金額                             | D            | 82,817,868円    |
| 当ファンドの分配対象収益額                        | E=A+B+C+D    | 183,640,541円   | 当ファンドの分配対象収益額                        | E=A+B+C+D    | 224,146,668円   |
| 当ファンドの期末残存口数                         | F            | 1,122,495,776口 | 当ファンドの期末残存口数                         | F            | 1,092,229,027口 |
| 1万口当たり収益分配対象額                        | G=E/F*10,000 | 1,635円         | 1万口当たり収益分配対象額                        | G=E/F*10,000 | 2,052円         |
| 1万口当たり分配金額                           | H            | 16円            | 1万口当たり分配金額                           | H            | 16円            |
| 収益分配金金額                              | I=F*H/10,000 | 1,795,993円     | 収益分配金金額                              | I=F*H/10,000 | 1,747,566円     |
| 第200期<br>2023年11月18日<br>2023年12月18日  |              |                | 第206期<br>2024年 5月18日<br>2024年 6月17日  |              |                |
| 項目                                   |              |                | 項目                                   |              |                |
| 費用控除後の配当等収益額                         | A            | 1,459,536円     | 費用控除後の配当等収益額                         | A            | 2,304,596円     |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額            | B            | —円             | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額            | B            | 10,519,960円    |
| 収益調整金額                               | C            | 112,351,710円   | 収益調整金額                               | C            | 109,814,974円   |
| 分配準備積立金額                             | D            | 68,772,635円    | 分配準備積立金額                             | D            | 109,344,074円   |
| 当ファンドの分配対象収益額                        | E=A+B+C+D    | 182,583,881円   | 当ファンドの分配対象収益額                        | E=A+B+C+D    | 231,983,604円   |
| 当ファンドの期末残存口数                         | F            | 1,118,021,142口 | 当ファンドの期末残存口数                         | F            | 1,076,302,572口 |
| 1万口当たり収益分配対象額                        | G=E/F*10,000 | 1,633円         | 1万口当たり収益分配対象額                        | G=E/F*10,000 | 2,155円         |
| 1万口当たり分配金額                           | H            | 16円            | 1万口当たり分配金額                           | H            | 16円            |
| 収益分配金金額                              | I=F*H/10,000 | 1,788,833円     | 収益分配金金額                              | I=F*H/10,000 | 1,722,084円     |
| 第201期<br>2023年12月19日<br>2024年 1月17日  |              |                | 第207期<br>2024年 6月18日<br>2024年 7月17日  |              |                |
| 項目                                   |              |                | 項目                                   |              |                |
| 費用控除後の配当等収益額                         | A            | 2,088,794円     | 費用控除後の配当等収益額                         | A            | 2,314,311円     |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額            | B            | —円             | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額            | B            | 18,778,496円    |
| 収益調整金額                               | C            | 111,922,946円   | 収益調整金額                               | C            | 108,572,659円   |
| 分配準備積立金額                             | D            | 67,687,903円    | 分配準備積立金額                             | D            | 118,274,698円   |
| 当ファンドの分配対象収益額                        | E=A+B+C+D    | 181,699,643円   | 当ファンドの分配対象収益額                        | E=A+B+C+D    | 247,940,164円   |

| 前期<br>自 2023年 7月19日<br>至 2024年 1月17日 |                |                | 当期<br>自 2024年 1月18日<br>至 2024年 7月17日 |                |                |
|--------------------------------------|----------------|----------------|--------------------------------------|----------------|----------------|
| 当ファンドの期末残存口数                         | F              | 1,110,675,808口 | 当ファンドの期末残存口数                         | F              | 1,060,333,734口 |
| 1万口当たり収益分配対象額                        | $G=E/F*10,000$ | 1,635円         | 1万口当たり収益分配対象額                        | $G=E/F*10,000$ | 2,338円         |
| 1万口当たり分配金額                           | H              | 16円            | 1万口当たり分配金額                           | H              | 16円            |
| 収益分配金金額                              | $I=F*H/10,000$ | 1,777,081円     | 収益分配金金額                              | $I=F*H/10,000$ | 1,696,533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<br>自 2023年 7月19日<br>至 2024年 1月17日                                                                                                                                                           | 当期<br>自 2024年 1月18日<br>至 2024年 7月17日 |
|--------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。                                                                                        | 同左                                   |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、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。<br>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<br>[ 2024年 1月17日現在 ]                                                                                                                                                               | 当期<br>[ 2024年 7月17日現在 ]                                  |
|----------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                                                                                                | 同左                                                       |
| 2. 時価の算定方法                 | （１）有価証券<br>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。<br>（２）デリバティブ取引<br>デリバティブ取引は、該当事項はありません。<br>（３）上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 | （１）有価証券<br>同左<br>（２）デリバティブ取引<br>同左<br>（３）上記以外の金融商品<br>同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。                                                                                                                      | 同左                                                       |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種類        | 前期<br>[ 2024年 1月17日現在 ]   | 当期<br>[ 2024年 7月17日現在 ]   |
|-----------|---------------------------|---------------------------|
|           | 最終計算期間の損益に含まれた評価差額<br>（円） | 最終計算期間の損益に含まれた評価差額<br>（円） |
| 親投資信託受益証券 | 28,650,200                | 21,867,708                |
| 合計        | 28,650,200                | 21,867,708                |

## （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<br>[ 2024年 1月17日現在 ] | 当期<br>[ 2024年 7月17日現在 ] |
|---------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 0.9460円<br>(9,460円)     | 1.0177円<br>(10,177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<br>証券 | 外国債券インデックスマザーファンド | 383,653,075 | 1,078,794,081 |    |
| 合 計           |                   | 383,653,075 | 1,078,794,081 |    |

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 7月17日現在 ] |                 |
|-------------------|-----------------|
| 資産の部              |                 |
| 流動資産              |                 |
| 預金                | 3,687,664,011   |
| コール・ローン           | 3,999,855,905   |
| 国債証券              | 666,615,757,886 |
| 派生商品評価勘定          | 150,924         |
| 未収入金              | 1,713,840       |
| 未収利息              | 5,111,195,702   |
| 前払費用              | 680,624,702     |
| 流動資産合計            | 680,096,962,970 |
| 資産合計              | 680,096,962,970 |
| 負債の部              |                 |
| 流動負債              |                 |
| 派生商品評価勘定          | 45,693,622      |
| 未払金               | 634,352,252     |
| 未払解約金             | 681,739,928     |
| 流動負債合計            | 1,361,785,802   |
| 負債合計              | 1,361,785,802   |
| 純資産の部             |                 |

[ 2024年 7月17日現在 ]

|             |                 |
|-------------|-----------------|
| 元本等         |                 |
| 元本          | 241,378,234,193 |
| 剰余金         |                 |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 437,356,942,975 |
| 元本等合計       | 678,735,177,168 |
| 純資産合計       | 678,735,177,168 |
| 負債純資産合計     | 680,096,962,970 |

## 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<br>「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 7月17日現在]  |
|----------------------------------|------------------|
| 1. 期首                            | 2024年 1月18日      |
| 期首元本額                            | 205,392,456,663円 |
| 期中追加設定元本額                        | 52,079,523,841円  |
| 期中一部解約元本額                        | 16,093,746,311円  |
| 元本の内訳                            |                  |
| 三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）           | 266,932,367円     |
| 三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）         | 676,828,097円     |
| 三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）           | 468,353,609円     |
| 三菱ＵＦＪ 外国債券オープン                   | 797,634,192円     |
| 三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）      | 1,981,519,226円   |
| 三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）    | 6,093,540,830円   |
| 三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）      | 5,170,881,624円   |
| 三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）        | 508,474,898円     |
| 三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド（成長型）           | 95,619,540円      |
| ファンド・マネジャー（海外債券）                 | 647,582,843円     |
| eMAXIS 先進国債券インデックス               | 6,515,310,219円   |
| eMAXIS バランス（8資産均等型）              | 2,410,485,275円   |
| eMAXIS バランス（波乗り型）                | 210,997,057円     |
| 三菱ＵＦＪ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）      | 1,055,989,422円   |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金） | 413,818,712円     |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金） | 254,479,994円     |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金） | 176,747,873円     |
| eMAXIS Slim 先進国債券インデックス          | 53,453,866,169円  |
| 海外債券セクション（ラップ向け）                 | 3,197,362,310円   |
| eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）         | 13,061,818,645円  |
| つみたて8資産均等バランス                    | 6,564,114,731円   |
| つみたて4資産均等バランス                    | 2,508,922,659円   |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s            | 5,025,606円       |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s            | 3,768,425円       |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s            | 746,565円         |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金） | 240,502,195円     |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金） | 173,414,951円     |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金） | 100,742,654円     |

|                                       | [2024年 7月17日現在] |
|---------------------------------------|-----------------|
| 三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式１５）                  | 778,984,992円    |
| 三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式４０）                  | 1,303,627,026円  |
| 三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式６５）                  | 2,190,177,422円  |
| 三菱ＵＦＪ ＤＣ年金インデックス（先進国債券）               | 2,736,926,104円  |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金）      | 90,278,208円     |
| 三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式２５）                  | 172,790,804円    |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６５（確定拠出年金）      | 44,621,533円     |
| ラップ向けインデックスf 先進国債券                    | 3,328,575,583円  |
| 三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式８０）                  | 47,745,884円     |
| ラップ向けアクティブアロケーションファンド                 | 31,318,084円     |
| アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）               | 47,768,450円     |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０７０（確定拠出年金）      | 751,008円        |
| 三菱ＵＦＪ 外国債券オープン（確定拠出年金）                | 3,202,777,747円  |
| 三菱ＵＦＪ 外国債券オープン（毎月分配型）                 | 15,939,208,159円 |
| ワールド・インカムオープン                         | 944,270,315円    |
| 三菱ＵＦＪ ＤＣ海外債券インデックスファンド                | 15,431,347,411円 |
| 三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）           | 383,653,075円    |
| 三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド（年１回決算型）          | 2,425,202,396円  |
| eMAXIS バランス（４資産均等型）                   | 1,021,398,740円  |
| eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）             | 547,443,216円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）             | 304,370,909円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）            | 584,480,148円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）               | 244,753,931円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）              | 92,113,808円     |
| 三菱ＵＦＪ 外国債券ファンドVA（適格機関投資家限定）           | 903,627,566円    |
| 三菱ＵＦＪ 外国債券ファンドVA２（適格機関投資家限定）          | 8,776,233円      |
| MUAM 世界債券オープン（適格機関投資家限定）              | 761,438,601円    |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンド４５VA（適格機関投資家限定）         | 10,711,005円     |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンド４０VA（適格機関投資家限定）         | 1,386,859,263円  |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンドVA ４０型（適格機関投資家限定）       | 1,047,734,064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）        | 48,862,371,711円 |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンドVA ５０型（適格機関投資家限定）       | 435,515,595円    |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンド５５VA（適格機関投資家限定）         | 372,733円        |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンドVA ３０型（適格機関投資家限定）       | 100,238円        |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンド２０VA（適格機関投資家限定）         | 1,138,929,481円  |
| アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）         | 31,727,206円     |
| アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）         | 55,568,872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） | 1,022,914,625円  |
| 世界８資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）            | 34,833,512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）      | 4,334,097,214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）   | 531,396,236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）            | 33,907,513円     |
| 海外債券インデックスファンドS                       | 6,355,642,354円  |
| グローバルバランスオープンV（適格機関投資家限定）             | 5,984,798円      |
| MUAM グローバルバランス（退職給付信託向け）（適格機関投資家限定）   | 12,357,414,449円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA            | 1,529,280円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA          | 2,502,933円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA            | 499,180円        |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA            | 847,072円        |
| 三菱ＵＦＪ 外国債券インデックスファンドVA                | 4,218,903円      |
| 三菱ＵＦＪ バランスVA３０D（適格機関投資家限定）            | 3,420,018円      |
| 三菱ＵＦＪ バランスVA６０D（適格機関投資家限定）            | 7,425,010円      |
| 三菱ＵＦＪ バランスVA３０G（適格機関投資家限定）            | 3,309,669円      |
| 三菱ＵＦＪ バランスVA６０G（適格機関投資家限定）            | 8,789,167円      |
| 三菱ＵＦＪ <DC>外国債券インデックスファンド              | 1,742,977,036円  |

|                                       | [2024年 7月17日現在]  |
|---------------------------------------|------------------|
| 三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）   | 180,859,163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） | 524,783,330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）   | 438,785,716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）   | 188,298,806円     |
| 合計                                    | 241,378,234,193円 |
| 2. 受益権の総数                             | 241,378,234,193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 2024年 1月18日<br>至 2024年 7月17日                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。                                                                                                                                                                                                       |
| 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。<br>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。<br>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。                |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | 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。<br>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。<br>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 7月17日現在 ]                                                                                                                                                                                    |
|----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                                                                                                               |
| 2. 時価の算定方法                 | （１）有価証券<br>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。<br>（２）デリバティブ取引<br>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。<br>（３）上記以外の金融商品<br>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 7月17日現在 ]  |
|------|--------------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 国債証券 | 9,734,196,799      |
| 合計   | 9,734,196,799      |

（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 7月17日現在 〕

| 区分        | 種類           | 契約額等（円）       |       | 時価（円）         | 評価損益（円）    |
|-----------|--------------|---------------|-------|---------------|------------|
|           |              |               | うち1年超 |               |            |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引<br>買建 |               |       |               |            |
|           | アメリカドル       | 3,990,601,080 | —     | 3,945,272,160 | 45,328,920 |
|           | カナダドル        | 30,131,764    | —     | 30,131,634    | 130        |
|           | オーストラリアドル    | 26,679,000    | —     | 26,678,625    | 375        |
|           | イギリスポンド      | 88,400,647    | —     | 88,399,658    | 989        |
|           | シンガポールドル     | 10,616,535    | —     | 10,615,968    | 567        |
|           | スウェーデンクローネ   | 7,488,850     | —     | 7,488,200     | 650        |
|           | デンマーククローネ    | 6,938,100     | —     | 6,950,370     | 12,270     |
|           | メキシコペソ       | 17,948,400    | —     | 17,947,200    | 1,200      |
|           | ポーランドズロチ     | 15,328,858    | —     | 15,328,516    | 342        |
|           | 中国元          | 152,723,900   | —     | 152,657,400   | 66,500     |
|           | オフショア元       | 46,857,320    | —     | 46,683,810    | 173,510    |
|           | ユーロ          | 530,312,190   | —     | 530,330,405   | 18,215     |
| 合計        |              | 4,924,026,644 | —     | 4,878,483,946 | 45,542,698 |

（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。

為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

（イ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

（ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 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 7月17日現在 〕 |
|--------------|-------------------|
| 1口当たり純資産額    | 2.8119円           |
| (1万口当たり純資産額) | (28,119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 250831 | 6,700,000.00  | 6,370,757.84 |    |
|        |      | 0.25 T-NOTE 250930 | 7,600,000.00  | 7,203,226.57 |    |
|        |      | 0.25 T-NOTE 251031 | 10,300,000.00 | 9,732,091.78 |    |

|                     |               |               |  |
|---------------------|---------------|---------------|--|
| 0.375 T-NOTE 251130 | 10,150,000.00 | 9,576,485.31  |  |
| 0.375 T-NOTE 251231 | 8,500,000.00  | 7,996,142.61  |  |
| 0.375 T-NOTE 260131 | 11,700,000.00 | 10,973,320.25 |  |
| 0.375 T-NOTE 270731 | 7,150,000.00  | 6,376,626.97  |  |
| 0.375 T-NOTE 270930 | 7,300,000.00  | 6,474,187.50  |  |
| 0.5 T-NOTE 260228   | 9,900,000.00  | 9,277,576.20  |  |
| 0.5 T-NOTE 270430   | 5,280,000.00  | 4,767,056.23  |  |
| 0.5 T-NOTE 270531   | 5,490,000.00  | 4,943,573.43  |  |
| 0.5 T-NOTE 270630   | 5,900,000.00  | 5,298,246.07  |  |
| 0.5 T-NOTE 270831   | 6,650,000.00  | 5,938,501.92  |  |
| 0.5 T-NOTE 271031   | 8,590,000.00  | 7,626,812.66  |  |
| 0.625 T-NOTE 260731 | 7,930,000.00  | 7,352,287.12  |  |
| 0.625 T-NOTE 270331 | 3,800,000.00  | 3,452,062.50  |  |
| 0.625 T-NOTE 271130 | 8,780,000.00  | 7,808,883.97  |  |
| 0.625 T-NOTE 271231 | 8,630,000.00  | 7,655,079.68  |  |
| 0.625 T-NOTE 300515 | 14,210,000.00 | 11,668,019.70 |  |
| 0.625 T-NOTE 300815 | 17,350,000.00 | 14,129,406.25 |  |
| 0.75 T-NOTE 260331  | 13,590,000.00 | 12,757,347.08 |  |
| 0.75 T-NOTE 260430  | 9,200,000.00  | 8,615,296.85  |  |
| 0.75 T-NOTE 260531  | 11,500,000.00 | 10,741,943.33 |  |
| 0.75 T-NOTE 260831  | 10,100,000.00 | 9,365,382.76  |  |
| 0.75 T-NOTE 280131  | 9,950,000.00  | 8,841,507.80  |  |
| 0.875 T-NOTE 260630 | 8,300,000.00  | 7,756,609.37  |  |
| 0.875 T-NOTE 260930 | 10,000,000.00 | 9,281,250.00  |  |
| 0.875 T-NOTE 301115 | 22,310,000.00 | 18,338,645.75 |  |
| 1 T-NOTE 280731     | 9,150,000.00  | 8,093,282.23  |  |
| 1.125 T-BOND 400515 | 6,890,000.00  | 4,352,811.31  |  |
| 1.125 T-BOND 400815 | 9,380,000.00  | 5,871,293.74  |  |
| 1.125 T-NOTE 261031 | 10,450,000.00 | 9,724,214.89  |  |
| 1.125 T-NOTE 270228 | 2,950,000.00  | 2,722,527.32  |  |
| 1.125 T-NOTE 280229 | 9,760,000.00  | 8,771,800.00  |  |
| 1.125 T-NOTE 280831 | 14,930,000.00 | 13,244,543.03 |  |
| 1.125 T-NOTE 310215 | 17,120,000.00 | 14,227,990.63 |  |
| 1.25 T-BOND 500515  | 10,720,000.00 | 5,475,365.63  |  |
| 1.25 T-NOTE 261130  | 11,360,000.00 | 10,582,106.27 |  |
| 1.25 T-NOTE 261231  | 8,200,000.00  | 7,627,921.91  |  |
| 1.25 T-NOTE 280331  | 9,950,000.00  | 8,965,688.48  |  |
| 1.25 T-NOTE 280430  | 9,740,000.00  | 8,757,629.63  |  |
| 1.25 T-NOTE 280531  | 9,750,000.00  | 8,748,720.72  |  |
| 1.25 T-NOTE 280630  | 9,680,000.00  | 8,669,082.84  |  |
| 1.25 T-NOTE 280930  | 10,700,000.00 | 9,522,373.08  |  |
| 1.25 T-NOTE 310815  | 19,990,000.00 | 16,500,339.49 |  |
|                     | 9,910,000.00  | 6,422,531.66  |  |

|                     |               |               |  |
|---------------------|---------------|---------------|--|
| 1.375 T-BOND 401115 |               |               |  |
| 1.375 T-BOND 500815 | 11,180,000.00 | 5,894,392.94  |  |
| 1.375 T-NOTE 260831 | 3,800,000.00  | 3,570,738.28  |  |
| 1.375 T-NOTE 281031 | 9,050,000.00  | 8,081,367.18  |  |
| 1.375 T-NOTE 281231 | 8,700,000.00  | 7,740,111.33  |  |
| 1.375 T-NOTE 311115 | 20,320,000.00 | 16,815,593.69 |  |
| 1.5 T-NOTE 260815   | 9,740,000.00  | 9,183,374.19  |  |
| 1.5 T-NOTE 270131   | 13,540,000.00 | 12,642,710.56 |  |
| 1.5 T-NOTE 281130   | 9,700,000.00  | 8,693,056.67  |  |
| 1.5 T-NOTE 300215   | 9,680,000.00  | 8,432,187.49  |  |
| 1.625 T-BOND 501115 | 11,410,000.00 | 6,430,604.68  |  |
| 1.625 T-NOTE 260215 | 9,760,000.00  | 9,324,231.22  |  |
| 1.625 T-NOTE 260515 | 7,670,000.00  | 7,289,196.46  |  |
| 1.625 T-NOTE 260930 | 5,500,000.00  | 5,187,187.50  |  |
| 1.625 T-NOTE 261031 | 3,350,000.00  | 3,153,580.08  |  |
| 1.625 T-NOTE 261130 | 3,400,000.00  | 3,194,671.89  |  |
| 1.625 T-NOTE 290815 | 7,050,000.00  | 6,264,035.12  |  |
| 1.625 T-NOTE 310515 | 17,540,000.00 | 14,970,321.41 |  |
| 1.75 T-BOND 410815  | 14,850,000.00 | 10,080,887.74 |  |
| 1.75 T-NOTE 261231  | 4,700,000.00  | 4,424,058.58  |  |
| 1.75 T-NOTE 290131  | 10,040,000.00 | 9,067,963.23  |  |
| 1.75 T-NOTE 291115  | 5,150,000.00  | 4,585,712.90  |  |
| 1.875 T-BOND 410215 | 10,700,000.00 | 7,509,435.58  |  |
| 1.875 T-BOND 510215 | 12,560,000.00 | 7,550,228.08  |  |
| 1.875 T-BOND 511115 | 12,630,000.00 | 7,548,891.76  |  |
| 1.875 T-NOTE 260630 | 5,100,000.00  | 4,859,742.16  |  |
| 1.875 T-NOTE 260731 | 5,500,000.00  | 5,230,800.79  |  |
| 1.875 T-NOTE 270228 | 9,120,000.00  | 8,583,843.77  |  |
| 1.875 T-NOTE 290228 | 7,800,000.00  | 7,074,996.08  |  |
| 1.875 T-NOTE 320215 | 16,860,000.00 | 14,405,421.05 |  |
| 2 T-BOND 411115     | 10,220,000.00 | 7,202,704.63  |  |
| 2 T-BOND 500215     | 8,590,000.00  | 5,365,058.95  |  |
| 2 T-BOND 510815     | 12,060,000.00 | 7,453,645.36  |  |
| 2 T-NOTE 250815     | 8,600,000.00  | 8,350,400.56  |  |
| 2 T-NOTE 261115     | 8,680,000.00  | 8,234,980.47  |  |
| 2.125 T-NOTE 260531 | 5,000,000.00  | 4,792,578.10  |  |
| 2.25 T-BOND 410515  | 9,320,000.00  | 6,918,461.73  |  |
| 2.25 T-BOND 460815  | 5,730,000.00  | 3,922,140.24  |  |
| 2.25 T-BOND 490815  | 6,950,000.00  | 4,618,492.18  |  |
| 2.25 T-BOND 520215  | 10,280,000.00 | 6,742,635.96  |  |
| 2.25 T-NOTE 251115  | 10,290,000.00 | 9,968,035.57  |  |
| 2.25 T-NOTE 260331  | 4,500,000.00  | 4,333,974.61  |  |
| 2.25 T-NOTE 270215  | 11,010,000.00 | 10,469,821.87 |  |

|                     |               |               |  |
|---------------------|---------------|---------------|--|
| 2.25 T-NOTE 270815  | 9,390,000.00  | 8,862,546.04  |  |
| 2.25 T-NOTE 271115  | 7,500,000.00  | 7,053,222.67  |  |
| 2.375 T-BOND 420215 | 8,920,000.00  | 6,654,459.32  |  |
| 2.375 T-BOND 491115 | 6,600,000.00  | 4,503,210.95  |  |
| 2.375 T-BOND 510515 | 12,850,000.00 | 8,697,090.86  |  |
| 2.375 T-NOTE 260430 | 4,000,000.00  | 3,856,406.24  |  |
| 2.375 T-NOTE 270515 | 18,570,000.00 | 17,655,282.46 |  |
| 2.375 T-NOTE 290331 | 12,000,000.00 | 11,119,218.72 |  |
| 2.375 T-NOTE 290515 | 8,510,000.00  | 7,871,916.20  |  |
| 2.5 T-BOND 450215   | 5,050,000.00  | 3,692,812.50  |  |
| 2.5 T-BOND 460215   | 5,410,000.00  | 3,911,894.92  |  |
| 2.5 T-BOND 460515   | 4,210,000.00  | 3,036,791.38  |  |
| 2.5 T-NOTE 260228   | 3,450,000.00  | 3,339,761.73  |  |
| 2.5 T-NOTE 270331   | 7,700,000.00  | 7,364,177.74  |  |
| 2.625 T-NOTE 251231 | 3,200,000.00  | 3,110,500.00  |  |
| 2.625 T-NOTE 260131 | 3,900,000.00  | 3,786,199.20  |  |
| 2.625 T-NOTE 270531 | 7,900,000.00  | 7,561,781.25  |  |
| 2.625 T-NOTE 290215 | 9,640,000.00  | 9,047,102.30  |  |
| 2.625 T-NOTE 290731 | 6,790,000.00  | 6,338,571.05  |  |
| 2.75 T-BOND 420815  | 2,520,000.00  | 1,984,401.56  |  |
| 2.75 T-BOND 421115  | 3,700,000.00  | 2,904,355.47  |  |
| 2.75 T-BOND 470815  | 5,190,000.00  | 3,884,897.48  |  |
| 2.75 T-BOND 471115  | 5,710,000.00  | 4,266,217.59  |  |
| 2.75 T-NOTE 250831  | 4,050,000.00  | 3,960,140.62  |  |
| 2.75 T-NOTE 270430  | 10,100,000.00 | 9,709,216.75  |  |
| 2.75 T-NOTE 270731  | 7,650,000.00  | 7,334,586.90  |  |
| 2.75 T-NOTE 280215  | 9,990,000.00  | 9,520,157.81  |  |
| 2.75 T-NOTE 290531  | 7,160,000.00  | 6,735,294.50  |  |
| 2.75 T-NOTE 320815  | 17,340,000.00 | 15,697,102.79 |  |
| 2.875 T-BOND 430515 | 4,680,000.00  | 3,721,696.89  |  |
| 2.875 T-BOND 450815 | 3,500,000.00  | 2,723,847.66  |  |
| 2.875 T-BOND 461115 | 2,340,000.00  | 1,802,211.32  |  |
| 2.875 T-BOND 490515 | 8,570,000.00  | 6,498,135.56  |  |
| 2.875 T-BOND 520515 | 10,840,000.00 | 8,169,379.66  |  |
| 2.875 T-NOTE 250731 | 6,100,000.00  | 5,980,150.61  |  |
| 2.875 T-NOTE 251130 | 3,800,000.00  | 3,709,304.67  |  |
| 2.875 T-NOTE 280515 | 11,990,000.00 | 11,449,044.89 |  |
| 2.875 T-NOTE 280815 | 10,310,000.00 | 9,821,483.22  |  |
| 2.875 T-NOTE 290430 | 8,000,000.00  | 7,575,937.52  |  |
| 2.875 T-NOTE 320515 | 17,030,000.00 | 15,603,072.30 |  |
| 3 T-BOND 420515     | 2,270,000.00  | 1,864,237.50  |  |
| 3 T-BOND 441115     | 3,900,000.00  | 3,119,847.66  |  |
|                     |               |               |  |

|                     |               |               |
|---------------------|---------------|---------------|
| 3 T-BOND 450515     | 2,790,000.00  | 2,221,700.96  |
| 3 T-BOND 451115     | 2,000,000.00  | 1,586,953.12  |
| 3 T-BOND 470215     | 5,290,000.00  | 4,161,432.24  |
| 3 T-BOND 470515     | 3,990,000.00  | 3,132,773.43  |
| 3 T-BOND 480215     | 5,970,000.00  | 4,664,645.53  |
| 3 T-BOND 480815     | 7,070,000.00  | 5,507,005.26  |
| 3 T-BOND 490215     | 7,850,000.00  | 6,104,141.62  |
| 3 T-BOND 520815     | 9,700,000.00  | 7,504,427.68  |
| 3 T-NOTE 250930     | 5,400,000.00  | 5,290,101.57  |
| 3 T-NOTE 251031     | 3,300,000.00  | 3,229,617.20  |
| 3.125 T-BOND 411115 | 1,990,000.00  | 1,676,497.27  |
| 3.125 T-BOND 420215 | 2,200,000.00  | 1,847,226.56  |
| 3.125 T-BOND 430215 | 3,160,000.00  | 2,617,985.92  |
| 3.125 T-BOND 440815 | 5,680,000.00  | 4,646,173.42  |
| 3.125 T-BOND 480515 | 7,240,000.00  | 5,777,010.95  |
| 3.125 T-NOTE 250815 | 5,000,000.00  | 4,912,896.40  |
| 3.125 T-NOTE 270831 | 7,300,000.00  | 7,072,873.05  |
| 3.125 T-NOTE 281115 | 14,380,000.00 | 13,812,944.97 |
| 3.125 T-NOTE 290831 | 5,900,000.00  | 5,635,537.10  |
| 3.25 T-BOND 420515  | 7,200,000.00  | 6,131,250.00  |
| 3.25 T-NOTE 270630  | 8,090,000.00  | 7,878,585.56  |
| 3.25 T-NOTE 290630  | 6,170,000.00  | 5,935,612.31  |
| 3.375 T-BOND 420815 | 6,370,000.00  | 5,507,312.87  |
| 3.375 T-BOND 440515 | 5,380,000.00  | 4,587,290.62  |
| 3.375 T-BOND 481115 | 8,120,000.00  | 6,767,671.08  |
| 3.375 T-NOTE 330515 | 16,800,000.00 | 15,836,624.99 |
| 3.5 T-BOND 390215   | 1,490,000.00  | 1,370,159.75  |
| 3.5 T-NOTE 250915   | 7,900,000.00  | 7,787,363.29  |
| 3.5 T-NOTE 280131   | 9,030,000.00  | 8,834,937.90  |
| 3.5 T-NOTE 280430   | 6,900,000.00  | 6,745,558.61  |
| 3.5 T-NOTE 300131   | 5,800,000.00  | 5,629,171.89  |
| 3.5 T-NOTE 300430   | 5,600,000.00  | 5,428,828.10  |
| 3.5 T-NOTE 330215   | 17,690,000.00 | 16,863,545.30 |
| 3.625 T-BOND 430815 | 3,400,000.00  | 3,021,617.19  |
| 3.625 T-BOND 440215 | 3,870,000.00  | 3,429,787.50  |
| 3.625 T-BOND 530215 | 9,740,000.00  | 8,522,119.54  |
| 3.625 T-BOND 530515 | 10,160,000.00 | 8,889,206.30  |
| 3.625 T-NOTE 260515 | 7,000,000.00  | 6,895,820.33  |
| 3.625 T-NOTE 280331 | 6,000,000.00  | 5,893,476.54  |
| 3.625 T-NOTE 280531 | 6,600,000.00  | 6,480,246.10  |
| 3.625 T-NOTE 300331 | 5,500,000.00  | 5,367,441.42  |
| 3.75 T-BOND 410815  | 2,060,000.00  | 1,900,430.46  |
| 3.75 T-BOND 431115  | 4,830,000.00  | 4,364,735.18  |

|                     |               |               |  |
|---------------------|---------------|---------------|--|
| 3.75 T-NOTE 260415  | 7,000,000.00  | 6,911,132.83  |  |
| 3.75 T-NOTE 281231  | 10,260,000.00 | 10,113,714.86 |  |
| 3.75 T-NOTE 300531  | 5,600,000.00  | 5,498,062.52  |  |
| 3.75 T-NOTE 300630  | 6,250,000.00  | 6,134,277.37  |  |
| 3.75 T-NOTE 301231  | 6,660,000.00  | 6,527,710.55  |  |
| 3.875 T-BOND 400815 | 2,560,000.00  | 2,426,099.98  |  |
| 3.875 T-BOND 430215 | 6,740,000.00  | 6,230,024.22  |  |
| 3.875 T-BOND 430515 | 6,920,000.00  | 6,389,106.25  |  |
| 3.875 T-NOTE 260115 | 6,700,000.00  | 6,629,205.05  |  |
| 3.875 T-NOTE 271130 | 6,900,000.00  | 6,834,503.88  |  |
| 3.875 T-NOTE 271231 | 7,000,000.00  | 6,934,785.13  |  |
| 3.875 T-NOTE 290930 | 6,030,000.00  | 5,965,342.36  |  |
| 3.875 T-NOTE 291130 | 6,190,000.00  | 6,122,538.65  |  |
| 3.875 T-NOTE 291231 | 5,700,000.00  | 5,637,322.28  |  |
| 3.875 T-NOTE 330815 | 18,320,000.00 | 17,924,259.41 |  |
| 4 T-BOND 421115     | 6,840,000.00  | 6,448,837.50  |  |
| 4 T-BOND 521115     | 9,790,000.00  | 9,164,931.40  |  |
| 4 T-NOTE 251215     | 7,750,000.00  | 7,681,127.92  |  |
| 4 T-NOTE 260215     | 8,000,000.00  | 7,929,687.52  |  |
| 4 T-NOTE 270115     | 12,300,000.00 | 12,213,035.18 |  |
| 4 T-NOTE 280229     | 7,640,000.00  | 7,600,158.61  |  |
| 4 T-NOTE 280630     | 8,990,000.00  | 8,948,386.09  |  |
| 4 T-NOTE 290131     | 10,050,000.00 | 10,010,349.62 |  |
| 4 T-NOTE 291031     | 6,600,000.00  | 6,568,160.14  |  |
| 4 T-NOTE 300228     | 6,130,000.00  | 6,098,392.18  |  |
| 4 T-NOTE 300731     | 5,400,000.00  | 5,370,257.82  |  |
| 4 T-NOTE 310131     | 6,950,000.00  | 6,908,598.64  |  |
| 4 T-NOTE 340215     | 25,750,000.00 | 25,418,066.52 |  |
| 4.125 T-BOND 530815 | 10,700,000.00 | 10,242,115.21 |  |
| 4.125 T-NOTE 260615 | 7,000,000.00  | 6,958,984.34  |  |
| 4.125 T-NOTE 270215 | 9,500,000.00  | 9,464,189.46  |  |
| 4.125 T-NOTE 270930 | 7,440,000.00  | 7,428,084.39  |  |
| 4.125 T-NOTE 271031 | 6,500,000.00  | 6,488,828.12  |  |
| 4.125 T-NOTE 280731 | 7,700,000.00  | 7,700,300.76  |  |
| 4.125 T-NOTE 290331 | 11,300,000.00 | 11,315,449.24 |  |
| 4.125 T-NOTE 300831 | 7,100,000.00  | 7,105,962.86  |  |
| 4.125 T-NOTE 310331 | 12,100,000.00 | 12,114,179.74 |  |
| 4.125 T-NOTE 321115 | 16,070,000.00 | 16,057,131.46 |  |
| 4.25 T-BOND 390515  | 2,270,000.00  | 2,263,704.29  |  |
| 4.25 T-BOND 401115  | 1,980,000.00  | 1,959,967.96  |  |
| 4.25 T-BOND 540215  | 13,340,000.00 | 13,058,609.35 |  |
| 4.25 T-NOTE 251015  | 6,000,000.00  | 5,966,132.82  |  |
|                     |               |               |  |

|                     |               |               |
|---------------------|---------------|---------------|
| 4.25 T-NOTE 251231  | 13,580,000.00 | 13,506,530.02 |
| 4.25 T-NOTE 260131  | 9,390,000.00  | 9,341,216.02  |
| 4.25 T-NOTE 270315  | 11,800,000.00 | 11,800,691.36 |
| 4.25 T-NOTE 290228  | 11,330,000.00 | 11,408,557.57 |
| 4.25 T-NOTE 310228  | 8,180,000.00  | 8,248,219.89  |
| 4.375 T-BOND 380215 | 1,280,000.00  | 1,303,649.99  |
| 4.375 T-BOND 391115 | 2,270,000.00  | 2,291,724.60  |
| 4.375 T-BOND 400515 | 2,080,000.00  | 2,096,331.24  |
| 4.375 T-BOND 410515 | 1,960,000.00  | 1,964,593.75  |
| 4.375 T-BOND 430815 | 7,570,000.00  | 7,473,009.37  |
| 4.375 T-NOTE 260815 | 7,600,000.00  | 7,596,289.07  |
| 4.375 T-NOTE 261215 | 9,640,000.00  | 9,655,250.76  |
| 4.375 T-NOTE 280831 | 7,000,000.00  | 7,066,445.33  |
| 4.375 T-NOTE 281130 | 9,310,000.00  | 9,411,100.82  |
| 4.375 T-NOTE 301130 | 6,250,000.00  | 6,343,627.93  |
| 4.375 T-NOTE 340515 | 8,780,000.00  | 8,928,848.37  |
| 4.5 T-BOND 360215   | 1,160,000.00  | 1,204,043.75  |
| 4.5 T-BOND 380515   | 1,330,000.00  | 1,369,484.37  |
| 4.5 T-BOND 390815   | 1,880,000.00  | 1,925,237.50  |
| 4.5 T-BOND 440215   | 6,580,000.00  | 6,597,478.10  |
| 4.5 T-NOTE 251115   | 7,500,000.00  | 7,481,542.94  |
| 4.5 T-NOTE 260331   | 8,780,000.00  | 8,775,884.37  |
| 4.5 T-NOTE 260715   | 6,500,000.00  | 6,509,775.41  |
| 4.5 T-NOTE 270415   | 13,000,000.00 | 13,083,789.03 |
| 4.5 T-NOTE 270515   | 12,500,000.00 | 12,587,402.37 |
| 4.5 T-NOTE 290531   | 3,700,000.00  | 3,768,796.87  |
| 4.5 T-NOTE 331115   | 19,430,000.00 | 19,932,447.75 |
| 4.625 T-BOND 400215 | 2,100,000.00  | 2,178,667.97  |
| 4.625 T-BOND 440515 | 2,350,000.00  | 2,395,714.81  |
| 4.625 T-BOND 540515 | 5,870,000.00  | 6,113,513.25  |
| 4.625 T-NOTE 260228 | 19,800,000.00 | 19,816,242.13 |
| 4.625 T-NOTE 260315 | 6,000,000.00  | 6,007,382.82  |
| 4.625 T-NOTE 260915 | 7,500,000.00  | 7,536,621.07  |
| 4.625 T-NOTE 261015 | 6,800,000.00  | 6,838,781.21  |
| 4.625 T-NOTE 261115 | 8,720,000.00  | 8,776,203.10  |
| 4.625 T-NOTE 270615 | 1,600,000.00  | 1,618,187.50  |
| 4.625 T-NOTE 280930 | 8,030,000.00  | 8,185,110.77  |
| 4.625 T-NOTE 290430 | 14,050,000.00 | 14,375,455.04 |
| 4.625 T-NOTE 300930 | 5,700,000.00  | 5,859,755.83  |
| 4.625 T-NOTE 310430 | 8,500,000.00  | 8,760,312.50  |
| 4.625 T-NOTE 310531 | 2,200,000.00  | 2,267,375.00  |
| 4.75 T-BOND 410215  | 2,010,000.00  | 2,108,458.60  |
| 4.75 T-BOND 431115  | 6,720,000.00  | 6,964,649.99  |

|          |      |                          |                  |                                       |  |
|----------|------|--------------------------|------------------|---------------------------------------|--|
|          |      | 4.75 T-BOND 531115       | 11,120,000.00    | 11,811,524.99                         |  |
|          |      | 4.875 T-NOTE 251130      | 8,400,000.00     | 8,420,343.79                          |  |
|          |      | 4.875 T-NOTE 281031      | 8,500,000.00     | 8,752,011.74                          |  |
|          |      | 4.875 T-NOTE 301031      | 6,100,000.00     | 6,357,820.28                          |  |
|          |      | 5 T-BOND 370515          | 1,020,000.00     | 1,103,950.78                          |  |
|          |      | 5 T-NOTE 250831          | 8,500,000.00     | 8,518,759.75                          |  |
|          |      | 5 T-NOTE 250930          | 7,600,000.00     | 7,620,484.35                          |  |
|          |      | 5 T-NOTE 251031          | 9,500,000.00     | 9,531,357.41                          |  |
|          |      | 5.25 T-BOND 281115       | 2,690,000.00     | 2,814,937.88                          |  |
|          |      | 5.375 T-BOND 310215      | 1,300,000.00     | 1,402,070.30                          |  |
|          |      | 6 T-BOND 260215          | 1,200,000.00     | 1,229,671.87                          |  |
|          |      | 6.125 T-BOND 271115      | 1,160,000.00     | 1,231,457.80                          |  |
|          |      | 6.25 T-BOND 300515       | 1,150,000.00     | 1,277,398.43                          |  |
| アメリカドル合計 |      |                          | 2,161,950,000.00 | 1,968,037,130.53<br>(312,051,967,416) |  |
| カナダドル    | 国債証券 | 0.25 CAN GOVT 260301     | 2,200,000.00     | 2,079,096.25                          |  |
|          |      | 0.5 CAN GOVT 250901      | 2,900,000.00     | 2,789,343.39                          |  |
|          |      | 0.5 CAN GOVT 301201      | 4,500,000.00     | 3,782,669.53                          |  |
|          |      | 1 CAN GOVT 260901        | 2,500,000.00     | 2,368,212.10                          |  |
|          |      | 1 CAN GOVT 270601        | 1,930,000.00     | 1,804,770.03                          |  |
|          |      | 1.25 CAN GOVT 270301     | 2,500,000.00     | 2,360,183.22                          |  |
|          |      | 1.25 CAN GOVT 300601     | 5,710,000.00     | 5,092,202.14                          |  |
|          |      | 1.5 CAN GOVT 260601      | 4,070,000.00     | 3,912,810.49                          |  |
|          |      | 1.5 CAN GOVT 310601      | 5,900,000.00     | 5,248,808.15                          |  |
|          |      | 1.5 CAN GOVT 311201      | 4,930,000.00     | 4,348,123.14                          |  |
|          |      | 1.75 CAN GOVT 531201     | 5,550,000.00     | 3,903,500.48                          |  |
|          |      | 2 CAN GOVT 280601        | 2,670,000.00     | 2,544,328.14                          |  |
|          |      | 2 CAN GOVT 320601        | 5,350,000.00     | 4,861,638.67                          |  |
|          |      | 2 CAN GOVT 511201        | 7,140,000.00     | 5,413,338.94                          |  |
|          |      | 2.25 CAN GOVT 290601     | 2,210,000.00     | 2,114,383.09                          |  |
|          |      | 2.25 CAN GOVT 291201     | 1,000,000.00     | 953,740.17                            |  |
|          |      | 2.5 CAN GOVT 321201      | 3,500,000.00     | 3,289,823.14                          |  |
|          |      | 2.75 CAN GOVT 270901     | 2,000,000.00     | 1,960,248.90                          |  |
|          |      | 2.75 CAN GOVT 330601     | 3,000,000.00     | 2,865,471.93                          |  |
|          |      | 2.75 CAN GOVT 481201     | 1,680,000.00     | 1,512,923.74                          |  |
|          |      | 2.75 CAN GOVT 551201     | 3,340,000.00     | 2,960,469.37                          |  |
|          |      | 2.75 CANADA GOVER 641201 | 1,250,000.00     | 1,111,508.15                          |  |
|          |      | 3 CAN GOVT 251001        | 3,000,000.00     | 2,964,031.32                          |  |
|          |      | 3 CAN GOVT 340601        | 4,540,000.00     | 4,405,651.26                          |  |
|          |      | 3.25 CAN GOVT 280901     | 2,600,000.00     | 2,590,753.62                          |  |
|          |      | 3.25 CAN GOVT 331201     | 3,170,000.00     | 3,144,934.20                          |  |
|          |      | 3.5 CAN GOVT 280301      | 2,000,000.00     | 2,007,924.74                          |  |

|             |      |                       |                |                                    |  |
|-------------|------|-----------------------|----------------|------------------------------------|--|
|             |      | 3.5 CAN GOVT 290901   | 2,500,000.00   | 2,523,032.00                       |  |
|             |      | 3.5 CAN GOVT 340301   | 2,020,000.00   | 2,048,220.20                       |  |
|             |      | 3.5 CAN GOVT 451201   | 1,650,000.00   | 1,682,195.88                       |  |
|             |      | 4 CAN GOVT 260501     | 3,200,000.00   | 3,212,378.33                       |  |
|             |      | 4 CAN GOVT 290301     | 5,060,000.00   | 5,206,668.83                       |  |
|             |      | 4 CAN GOVT 410601     | 1,200,000.00   | 1,293,224.94                       |  |
|             |      | 4.5 CAN GOVT 251101   | 2,540,000.00   | 2,555,593.94                       |  |
|             |      | 4.5 CAN GOVT 260201   | 5,200,000.00   | 5,246,702.28                       |  |
|             |      | 5 CAN GOVT 370601     | 1,330,000.00   | 1,552,973.87                       |  |
|             |      | 5.75 CAN GOVT 290601  | 950,000.00     | 1,056,405.44                       |  |
|             |      | 5.75 CAN GOVT 330601  | 1,430,000.00   | 1,692,807.13                       |  |
| カナダドル合計     |      |                       | 118,220,000.00 | 110,461,091.14<br>(12,804,649,684) |  |
| オーストラリアドル   | 国債証券 | 0.25 AUST GOVT 251121 | 3,650,000.00   | 3,463,490.91                       |  |
|             |      | 0.5 AUST GOVT 260921  | 4,100,000.00   | 3,802,569.06                       |  |
|             |      | 1 AUST GOVT 301221    | 4,260,000.00   | 3,526,252.91                       |  |
|             |      | 1 AUST GOVT 311121    | 5,310,000.00   | 4,263,515.55                       |  |
|             |      | 1.25 AUST GOVT 320521 | 5,070,000.00   | 4,087,016.33                       |  |
|             |      | 1.5 AUST GOVT 310621  | 3,740,000.00   | 3,156,846.44                       |  |
|             |      | 1.75 AUST GOVT 321121 | 5,090,000.00   | 4,217,896.19                       |  |
|             |      | 1.75 AUST GOVT 510621 | 3,490,000.00   | 1,927,223.16                       |  |
|             |      | 2.25 AUST GOVT 280521 | 2,900,000.00   | 2,726,070.09                       |  |
|             |      | 2.5 AUST GOVT 300521  | 3,940,000.00   | 3,627,738.45                       |  |
|             |      | 2.75 AUST GOVT 271121 | 4,390,000.00   | 4,226,308.75                       |  |
|             |      | 2.75 AUST GOVT 281121 | 3,040,000.00   | 2,895,667.60                       |  |
|             |      | 2.75 AUST GOVT 291121 | 2,980,000.00   | 2,803,104.27                       |  |
|             |      | 2.75 AUST GOVT 350621 | 2,220,000.00   | 1,924,099.61                       |  |
|             |      | 2.75 AUST GOVT 410521 | 2,620,000.00   | 2,066,976.73                       |  |
|             |      | 3 AUST GOVT 331121    | 4,100,000.00   | 3,712,422.08                       |  |
|             |      | 3 AUST GOVT 470321    | 2,420,000.00   | 1,855,984.39                       |  |
|             |      | 3.25 AUST GOVT 290421 | 3,400,000.00   | 3,294,326.47                       |  |
|             |      | 3.25 AUST GOVT 390621 | 2,130,000.00   | 1,851,530.74                       |  |
|             |      | 3.5 AUST GOVT 341221  | 3,090,000.00   | 2,891,495.52                       |  |
|             |      | 3.75 AUST GOVT 340521 | 3,700,000.00   | 3,553,079.80                       |  |
|             |      | 3.75 AUST GOVT 370421 | 3,150,000.00   | 2,965,818.68                       |  |
|             |      | 4.25 AUST GOVT 260421 | 2,490,000.00   | 2,497,130.86                       |  |
|             |      | 4.5 AUST GOVT 330421  | 5,200,000.00   | 5,307,728.92                       |  |
|             |      | 4.75 AUST GOVT 270421 | 3,050,000.00   | 3,111,907.07                       |  |
|             |      | 4.75 AUST GOVT 540621 | 1,270,000.00   | 1,285,260.95                       |  |
| オーストラリアドル合計 |      |                       | 90,800,000.00  | 81,041,461.53<br>(8,650,365,603)   |  |
|             | 国債証券 | 0.125 GILT 260130     | 2,600,000.00   | 2,452,450.00                       |  |

イギリス  
bond

|                   |              |              |  |
|-------------------|--------------|--------------|--|
| 0.125 GILT 280131 | 2,300,000.00 | 2,015,628.00 |  |
| 0.25 GILT 310731  | 5,110,000.00 | 3,975,324.50 |  |
| 0.375 GILT 261022 | 4,870,000.00 | 4,482,397.57 |  |
| 0.375 GILT 301022 | 3,100,000.00 | 2,505,074.35 |  |
| 0.5 GILT 290131   | 4,900,000.00 | 4,213,247.85 |  |
| 0.5 GILT 611022   | 3,700,000.00 | 1,133,107.61 |  |
| 0.625 GILT 350731 | 4,030,000.00 | 2,788,548.42 |  |
| 0.625 GILT 501022 | 3,240,000.00 | 1,324,884.60 |  |
| 0.875 GILT 291022 | 2,900,000.00 | 2,494,308.85 |  |
| 0.875 GILT 330731 | 5,140,000.00 | 3,920,630.09 |  |
| 0.875 GILT 460131 | 2,930,000.00 | 1,472,618.00 |  |
| 1 GILT 320131     | 5,880,000.00 | 4,757,907.84 |  |
| 1.125 GILT 390131 | 4,450,000.00 | 2,921,695.56 |  |
| 1.125 GILT 731022 | 1,750,000.00 | 646,383.50   |  |
| 1.25 GILT 270722  | 2,530,000.00 | 2,335,098.92 |  |
| 1.25 GILT 411022  | 4,250,000.00 | 2,637,023.00 |  |
| 1.25 GILT 510731  | 4,930,000.00 | 2,428,518.00 |  |
| 1.5 GILT 260722   | 3,630,000.00 | 3,445,768.78 |  |
| 1.5 GILT 470722   | 3,160,000.00 | 1,798,796.82 |  |
| 1.5 GILT 530731   | 3,920,000.00 | 2,015,272.00 |  |
| 1.625 GILT 281022 | 3,470,000.00 | 3,167,398.65 |  |
| 1.625 GILT 541022 | 2,470,000.00 | 1,300,504.40 |  |
| 1.625 GILT 711022 | 2,950,000.00 | 1,367,602.30 |  |
| 1.75 GILT 370907  | 3,690,000.00 | 2,773,662.30 |  |
| 1.75 GILT 490122  | 1,980,000.00 | 1,169,467.20 |  |
| 1.75 GILT 570722  | 3,230,000.00 | 1,725,799.98 |  |
| 2 GILT 250907     | 1,200,000.00 | 1,166,622.00 |  |
| 2.5 GILT 650722   | 2,480,000.00 | 1,578,419.08 |  |
| 3.25 GILT 330131  | 5,900,000.00 | 5,577,598.04 |  |
| 3.25 GILT 440122  | 4,270,000.00 | 3,576,196.73 |  |
| 3.5 GILT 251022   | 6,150,000.00 | 6,063,285.00 |  |
| 3.5 GILT 450122   | 3,440,000.00 | 2,969,064.00 |  |
| 3.5 GILT 680722   | 2,960,000.00 | 2,431,048.00 |  |
| 3.75 GILT 270307  | 2,000,000.00 | 1,974,636.06 |  |
| 3.75 GILT 380129  | 4,650,000.00 | 4,397,821.20 |  |
| 3.75 GILT 520722  | 2,110,000.00 | 1,845,553.70 |  |
| 3.75 GILT 531022  | 4,740,000.00 | 4,118,628.66 |  |
| 4 GILT 311022     | 1,800,000.00 | 1,801,207.44 |  |
| 4 GILT 600122     | 2,640,000.00 | 2,403,720.00 |  |
| 4 GILT 631022     | 3,080,000.00 | 2,793,704.76 |  |
| 4.125 GILT 270129 | 6,900,000.00 | 6,881,354.13 |  |
| 4.125 GILT 290722 | 2,400,000.00 | 2,412,000.00 |  |
|                   | 2,450,000.00 | 2,471,412.02 |  |

|                          |              |                          |              |                          |                                    |            |  |
|--------------------------|--------------|--------------------------|--------------|--------------------------|------------------------------------|------------|--|
|                          |              | 4.25 GILT 271207         |              |                          |                                    |            |  |
|                          |              | 4.25 GILT 320607         | 3,690,000.00 | 3,769,899.57             |                                    |            |  |
|                          |              | 4.25 GILT 360307         | 2,910,000.00 | 2,930,370.00             |                                    |            |  |
|                          |              | 4.25 GILT 390907         | 2,430,000.00 | 2,399,184.67             |                                    |            |  |
|                          |              | 4.25 GILT 401207         | 2,420,000.00 | 2,374,474.96             |                                    |            |  |
|                          |              | 4.25 GILT 461207         | 2,930,000.00 | 2,807,045.48             |                                    |            |  |
|                          |              | 4.25 GILT 491207         | 2,470,000.00 | 2,356,804.84             |                                    |            |  |
|                          |              | 4.25 GILT 551207         | 2,770,000.00 | 2,632,227.12             |                                    |            |  |
|                          |              | 4.375 GILT 540731        | 1,980,000.00 | 1,916,374.68             |                                    |            |  |
|                          |              | 4.5 GILT 280607          | 6,460,000.00 | 6,563,376.79             |                                    |            |  |
|                          |              | 4.5 GILT 340907          | 4,000,000.00 | 4,132,572.39             |                                    |            |  |
|                          |              | 4.5 GILT 421207          | 3,190,000.00 | 3,200,208.00             |                                    |            |  |
|                          |              | 4.625 GILT 340131        | 4,970,000.00 | 5,186,572.72             |                                    |            |  |
|                          |              | 4.75 GILT 301207         | 3,650,000.00 | 3,822,118.30             |                                    |            |  |
|                          |              | 4.75 GILT 381207         | 2,310,000.00 | 2,416,421.70             |                                    |            |  |
|                          |              | 4.75 GILT 431022         | 3,020,000.00 | 3,112,679.87             |                                    |            |  |
|                          |              | 6 GILT 281207            | 1,890,000.00 | 2,048,993.03             |                                    |            |  |
|                          |              | イギリスポンド合計                |              | 207,370,000.00           | 173,400,714.03<br>(35,658,122,833) |            |  |
|                          |              | シンガ<br>ポールド<br>ル         | 国債証券         | 1.25 SINGAPORG0VT 261101 | 700,000.00                         | 671,492.50 |  |
|                          |              |                          |              | 1.625 SINGAPORG0V 310701 | 1,050,000.00                       | 961,552.25 |  |
| 1.875 SINGAPORG0V 500301 | 1,090,000.00 |                          |              | 894,345.00               |                                    |            |  |
| 1.875 SINGAPORG0V 511001 | 950,000.00   |                          |              | 769,186.50               |                                    |            |  |
| 2.125 SINGAPORG0V 260601 | 1,530,000.00 |                          |              | 1,500,318.00             |                                    |            |  |
| 2.25 SINGAPORG0VT 360801 | 1,300,000.00 |                          |              | 1,205,801.29             |                                    |            |  |
| 2.375 SINGAPORG0V 390701 | 780,000.00   |                          |              | 722,038.20               |                                    |            |  |
| 2.625 SINGAPORG0V 280501 | 800,000.00   |                          |              | 788,400.00               |                                    |            |  |
| 2.625 SINGAPORG0V 320801 | 700,000.00   |                          |              | 682,823.06               |                                    |            |  |
| 2.75 SINGAPORG0VT 420401 | 980,000.00   |                          |              | 949,620.00               |                                    |            |  |
| 2.75 SINGAPORG0VT 460301 | 1,480,000.00 |                          |              | 1,430,605.00             |                                    |            |  |
| 2.875 SINGAPORG0V 270901 | 1,000,000.00 |                          |              | 994,800.00               |                                    |            |  |
| 2.875 SINGAPORG0V 280801 | 1,000,000.00 |                          |              | 996,501.03               |                                    |            |  |
| 2.875 SINGAPORG0V 290701 | 1,760,000.00 |                          |              | 1,754,413.44             |                                    |            |  |
| 2.875SINGAPORG0VT 300901 | 1,340,000.00 |                          |              | 1,334,179.20             |                                    |            |  |
| 3 SINGAPORG0VT 720801    | 910,000.00   |                          |              | 947,310.00               |                                    |            |  |
| 3.25 SINGAPORG0VT 540601 | 400,000.00   |                          |              | 434,800.00               |                                    |            |  |
| 3.375 SINGAPORG0V 330901 | 2,630,000.00 |                          |              | 2,714,675.48             |                                    |            |  |
| 3.5 SINGAPORG0VT 270301  | 2,700,000.00 |                          |              | 2,730,240.00             |                                    |            |  |
| シンガポールドル合計               |              |                          |              | 23,100,000.00            | 22,483,100.95<br>(2,652,556,250)   |            |  |
| マレーシ<br>アリン<br>ギット       | 国債証券         | 2.632 MALAYSIAGOV 310415 | 6,280,000.00 | 5,858,517.80             |                                    |            |  |
|                          |              | 3.502MALAYSIAG0VT 270531 | 3,000,000.00 | 3,002,325.00             |                                    |            |  |
|                          |              | 3.519 MALAYSIAGOV 280420 | 3,500,000.00 | 3,495,614.08             |                                    |            |  |

|                   |      |                          |               |               |               |
|-------------------|------|--------------------------|---------------|---------------|---------------|
|                   |      | 3.582 MALAYSIAGOV 320715 | 3,170,000.00  | 3,116,423.60  |               |
|                   |      | 3.733 MALAYSIAGO 280615  | 2,800,000.00  | 2,816,411.64  |               |
|                   |      | 3.757 MALAYSIAGOV 400522 | 3,980,000.00  | 3,852,226.83  |               |
|                   |      | 3.828 MALAYSIAGOV 340705 | 3,410,000.00  | 3,412,047.70  |               |
|                   |      | 3.844 MALAYSIAGOV 330415 | 2,400,000.00  | 2,400,760.80  |               |
|                   |      | 3.885 MALAYSIAGOV 290815 | 3,600,000.00  | 3,645,072.00  |               |
|                   |      | 3.892 MALAYSIAGOV 270315 | 4,400,000.00  | 4,445,413.28  |               |
|                   |      | 3.899 MALAYSIAGOV 271116 | 5,640,000.00  | 5,712,264.19  |               |
|                   |      | 3.9 MALAYSIAGOV 261130   | 2,900,000.00  | 2,932,549.89  |               |
|                   |      | 3.906 MALAYSIAGOV 260715 | 2,960,000.00  | 2,990,104.38  |               |
|                   |      | 3.955 MALAYSIAGOV 250915 | 1,740,000.00  | 1,753,538.94  |               |
|                   |      | 4.054 MALAYSIAGOV 390418 | 660,000.00    | 667,771.50    |               |
|                   |      | 4.065 MALAYSIAGOV 500615 | 5,250,000.00  | 5,154,899.82  |               |
|                   |      | 4.232MALAYSIAGOV 310630  | 2,550,000.00  | 2,619,584.14  |               |
|                   |      | 4.254 MALAYSIAGOV 350531 | 2,600,000.00  | 2,678,488.02  |               |
|                   |      | 4.392 MALAYSIAGOV 260415 | 1,940,000.00  | 1,973,733.49  |               |
|                   |      | 4.457 MALAYSIAGOV 530331 | 2,400,000.00  | 2,501,172.00  |               |
|                   |      | 4.498 MALAYSIAGOV 300415 | 4,240,000.00  | 4,409,276.06  |               |
|                   |      | 4.504 MALAYSIAGOV 290430 | 1,500,000.00  | 1,557,663.90  |               |
|                   |      | 4.642 MALAYSIAGOV 331107 | 3,750,000.00  | 3,987,075.00  |               |
|                   |      | 4.696 MALAYSIAGOV 421015 | 6,000,000.00  | 6,467,309.40  |               |
|                   |      | 4.736 MALAYSIAGOV 460315 | 1,650,000.00  | 1,786,596.24  |               |
|                   |      | 4.762 MALAYSIAGOV 370407 | 4,440,000.00  | 4,807,477.48  |               |
|                   |      | 4.893 MALAYSIAGOV 380608 | 3,360,000.00  | 3,690,323.28  |               |
|                   |      | 4.921 MALAYSIAGOV 480706 | 2,720,000.00  | 3,028,615.28  |               |
|                   |      | 4.935 MALAYSIAGOV 430930 | 2,050,000.00  | 2,270,403.70  |               |
|                   |      | マレーシアリングット合計             |               |               | 94,890,000.00 |
| ニュー<br>ジーラン<br>ドル | 国債証券 | 0.25 NZ GOVT 280515      | 2,000,000.00  | 1,729,285.26  |               |
|                   |      | 1.5 NZ GOVT 310515       | 1,870,000.00  | 1,571,665.86  |               |
|                   |      | 1.75 NZ GOVT 410515      | 600,000.00    | 395,826.87    |               |
|                   |      | 2 NZ GOVT 320515         | 2,300,000.00  | 1,953,391.19  |               |
|                   |      | 2.75 NZ GOVT 370415      | 1,450,000.00  | 1,200,306.47  |               |
|                   |      | 2.75 NZ GOVT 510515      | 1,180,000.00  | 825,726.03    |               |
|                   |      | 3 NZ GOVT 290420         | 1,700,000.00  | 1,620,451.20  |               |
|                   |      | 3.5 NZ GOVT 330414       | 1,900,000.00  | 1,785,059.69  |               |
|                   |      | 4.25 NZ GOVT 340515      | 620,000.00    | 613,897.30    |               |
|                   |      | 4.5 NZ GOVT 270415       | 1,800,000.00  | 1,813,694.04  |               |
|                   |      | 4.5 NZ GOVT 300515       | 1,000,000.00  | 1,017,978.20  |               |
|                   |      | 4.5 NZ GOVT 350515       | 1,200,000.00  | 1,207,843.20  |               |
|                   |      | 5 NZ GOVT 540515         | 620,000.00    | 643,365.19    |               |
|                   |      |                          | 18,240,000.00 | 16,378,490.50 |               |

|               |      |                          |               |                 |                 |
|---------------|------|--------------------------|---------------|-----------------|-----------------|
| ニュージーランドドル合計  |      |                          |               | (1,578,722,699) |                 |
| スウェーデン<br>クロネ | 国債証券 | 0.125 SWD GOVT 310512    | 9,450,000.00  | 8,343,074.25    |                 |
|               |      | 0.75 SWD GOVT 280512     | 17,500,000.00 | 16,688,458.32   |                 |
|               |      | 0.75 SWD GOVT 291112     | 12,200,000.00 | 11,448,053.00   |                 |
|               |      | 1 SWD GOVT 261112        | 8,960,000.00  | 8,715,365.65    |                 |
|               |      | 1.75 SWD GOVT 331111     | 11,500,000.00 | 11,236,914.38   |                 |
|               |      | 2.25 SWD GOVT 320601     | 6,750,000.00  | 6,865,979.85    |                 |
|               |      | 3.5 SWD GOVT 390330      | 6,470,000.00  | 7,554,889.60    |                 |
| スウェーデンクロネ合計   |      |                          | 72,830,000.00 | 70,852,735.05   | (1,061,373,971) |
| ノルウェー<br>クロネ  | 国債証券 | 1.25 NORWE GOVT 310917   | 4,700,000.00  | 4,060,085.60    |                 |
|               |      | 1.375 NORWE GOVT 300819  | 15,770,000.00 | 14,031,750.96   |                 |
|               |      | 1.5 NORWE GOVT 260219    | 6,040,000.00  | 5,826,779.54    |                 |
|               |      | 1.75 NORWE GOVT 270217   | 5,120,000.00  | 4,899,811.84    |                 |
|               |      | 1.75 NORWE GOVT 290906   | 4,600,000.00  | 4,245,385.40    |                 |
|               |      | 2 NORWE GOVT 280426      | 6,900,000.00  | 6,557,929.05    |                 |
|               |      | 2.125 NORWE GOVT 320518  | 10,500,000.00 | 9,571,170.00    |                 |
|               |      | 3 NORWE GOVT 330815      | 8,700,000.00  | 8,400,424.20    |                 |
|               |      | 3.5 NORWE GOVT 421006    | 4,000,000.00  | 4,057,836.80    |                 |
|               |      | 3.625 NORWE GOVT 340413  | 4,100,000.00  | 4,155,094.57    |                 |
| ノルウェークロネ合計    |      |                          | 70,430,000.00 | 65,806,267.96   | (968,010,201)   |
| デンマーク<br>クロネ  | 国債証券 | 0 DMK GOVT 311115        | 14,550,000.00 | 12,313,701.08   |                 |
|               |      | 0.25 DMK GOVT 521115     | 9,730,000.00  | 5,265,389.50    |                 |
|               |      | 0.5 DMK GOVT 271115      | 8,100,000.00  | 7,612,054.21    |                 |
|               |      | 0.5 DMK GOVT 291115      | 10,550,000.00 | 9,596,675.62    |                 |
|               |      | 1.75 DMK GOVT 251115     | 7,490,000.00  | 7,388,907.47    |                 |
|               |      | 2.25 DMK GOVT 331115     | 6,800,000.00  | 6,718,445.56    |                 |
|               |      | 4.5 DMK GOVT 391115      | 18,500,000.00 | 22,888,551.50   |                 |
| デンマーククロネ合計    |      |                          | 75,720,000.00 | 71,783,724.94   | (1,663,228,906) |
| メキシコ<br>ペソ    | 国債証券 | 10 MEXICAN BONOS 361120  | 12,350,000.00 | 12,607,672.25   |                 |
|               |      | 5.5 MEXICAN BONOS 270304 | 52,000,000.00 | 46,639,799.96   |                 |
|               |      | 5.75 MEXICAN BONO 260305 | 65,500,000.00 | 60,843,291.25   |                 |
|               |      | 7 MEXICAN BONOS 260903   | 42,000,000.00 | 39,327,120.00   |                 |
|               |      | 7.5 MEXICAN BONOS 270603 | 63,950,000.00 | 60,166,986.59   |                 |
|               |      | 7.5 MEXICAN BONOS 330526 | 60,200,000.00 | 52,268,048.00   |                 |
|               |      | 7.75 MEXICAN BONO 310529 | 68,050,000.00 | 61,522,939.33   |                 |
|               |      | 7.75 MEXICAN BONO 341123 | 23,400,000.00 | 20,449,360.62   |                 |
|               |      | 7.75 MEXICAN BONO 421113 | 57,940,000.00 | 47,258,383.23   |                 |
|               |      | 8 MEXICAN BONOS 350524   | 5,000,000.00  | 4,370,000.00    |                 |
|               |      | 8 MEXICAN BONOS 471107   | 47,100,000.00 | 38,850,494.81   |                 |
|               |      | 8 MEXICAN BONOS 530731   | 46,270,000.00 | 37,683,443.36   |                 |

|               |      |                          |                |                                   |  |
|---------------|------|--------------------------|----------------|-----------------------------------|--|
|               |      | 8.5 MEXICAN BONOS 290301 | 39,420,000.00  | 37,466,739.00                     |  |
|               |      | 8.5 MEXICAN BONOS 290531 | 48,650,000.00  | 46,397,438.34                     |  |
|               |      | 8.5 MEXICAN BONOS 381118 | 39,700,000.00  | 35,588,327.37                     |  |
| メキシコペソ合計      |      |                          | 671,530,000.00 | 601,440,044.11<br>(5,400,450,444) |  |
| イスラエル<br>シェケル | 国債証券 | 0.5 ISRAEL FIXED 260227  | 5,300,000.00   | 5,008,500.00                      |  |
|               |      | 1 ISRAEL FIXED BO 300331 | 6,620,000.00   | 5,506,847.00                      |  |
|               |      | 1.3 ISRAEL FIXED 320430  | 4,800,000.00   | 3,793,200.00                      |  |
|               |      | 1.5 ISRAEL FIXED 370531  | 4,900,000.00   | 3,351,600.00                      |  |
|               |      | 2 ISRAEL FIXED BO 270331 | 7,000,000.00   | 6,647,900.00                      |  |
|               |      | 2.25 ISRAEL FIXED 280928 | 3,080,000.00   | 2,892,890.00                      |  |
|               |      | 2.8 ISRAEL FIXED 521129  | 3,300,000.00   | 2,192,520.00                      |  |
|               |      | 3.75 ISRAEL FIXED 290228 | 4,600,000.00   | 4,547,330.00                      |  |
|               |      | 3.75 ISRAEL FIXED 470331 | 4,680,000.00   | 3,871,296.00                      |  |
|               |      | 4 ISRAEL FIXED BO 350330 | 1,700,000.00   | 1,619,505.00                      |  |
|               |      | 5.5 ISRAEL FIXED 420131  | 3,130,000.00   | 3,391,042.00                      |  |
|               |      | 6.25 ISRAEL FIXED 261030 | 5,000,000.00   | 5,443,750.00                      |  |
| イスラエルシェケル合計   |      |                          | 54,110,000.00  | 48,266,380.00<br>(2,118,807,202)  |  |
| ポーランド<br>ズロチ  | 国債証券 | 0.25 POLAND 261025       | 8,000,000.00   | 7,190,560.00                      |  |
|               |      | 1.25 POLAND 301025       | 9,190,000.00   | 7,230,898.77                      |  |
|               |      | 1.75 POLAND 320425       | 9,900,000.00   | 7,653,858.30                      |  |
|               |      | 2.5 POLAND 260725        | 7,840,000.00   | 7,467,511.80                      |  |
|               |      | 2.5 POLAND 270725        | 6,110,000.00   | 5,663,527.02                      |  |
|               |      | 2.75 POLAND 280425       | 5,760,000.00   | 5,285,472.48                      |  |
|               |      | 2.75 POLAND 291025       | 7,900,000.00   | 6,998,878.60                      |  |
|               |      | 3.25 POLAND 250725       | 8,700,000.00   | 8,587,987.50                      |  |
|               |      | 3.75 POLAND 270525       | 4,000,000.00   | 3,852,260.00                      |  |
|               |      | 4.75 POLAND 290725       | 4,000,000.00   | 3,906,341.80                      |  |
|               |      | 5.75 POLAND 290425       | 10,600,000.00  | 10,778,705.40                     |  |
|               |      | 6 POLAND 331025          | 7,720,000.00   | 8,015,933.84                      |  |
|               |      | 7.5 POLAND 280725        | 8,120,000.00   | 8,759,360.68                      |  |
| ポーランドズロチ合計    |      |                          | 97,840,000.00  | 91,391,296.19<br>(3,687,739,331)  |  |
| 中国元           | 国債証券 | 1.85 CHINA GOVT 270515   | 40,000,000.00  | 40,065,600.00                     |  |
|               |      | 1.99 CHINA GOVT 260315   | 35,000,000.00  | 35,220,780.00                     |  |
|               |      | 2.04 CHINA GOVT 270225   | 70,000,000.00  | 70,459,207.00                     |  |
|               |      | 2.05 CHINA GOVT 290415   | 44,000,000.00  | 44,154,440.00                     |  |
|               |      | 2.12 CHINA GOVT 310625   | 4,000,000.00   | 4,000,960.00                      |  |
|               |      | 2.18 CHINA GOVT 250825   | 34,000,000.00  | 34,221,051.00                     |  |
|               |      | 2.18 CHINA GOVT 260815   | 39,000,000.00  | 39,390,538.20                     |  |
|               |      | 2.22 CHINA GOVT 250925   | 50,000,000.00  | 50,372,285.00                     |  |
|               |      | 2.28 CHINA GOVT 251125   | 34,000,000.00  | 34,308,305.20                     |  |

|                        |               |               |  |
|------------------------|---------------|---------------|--|
| 2.28 CHINA GOVT 310325 | 48,000,000.00 | 48,515,400.00 |  |
| 2.3 CHINA GOVT 260515  | 54,000,000.00 | 54,625,606.20 |  |
| 2.33 CHINA GOVT 251215 | 45,000,000.00 | 45,447,408.00 |  |
| 2.35 CHINA GOVT 340225 | 59,000,000.00 | 59,197,626.40 |  |
| 2.37 CHINA GOVT 270120 | 28,000,000.00 | 28,419,792.80 |  |
| 2.37 CHINA GOVT 290115 | 58,000,000.00 | 58,957,226.20 |  |
| 2.39 CHINA GOVT 261115 | 88,000,000.00 | 89,303,376.80 |  |
| 2.4 CHINA GOVT 280715  | 63,000,000.00 | 64,042,448.40 |  |
| 2.44 CHINA GOVT 271015 | 35,000,000.00 | 35,631,466.50 |  |
| 2.46 CHINA GOVT 260215 | 86,000,000.00 | 87,058,986.80 |  |
| 2.48 CHINA GOVT 270415 | 28,000,000.00 | 28,518,064.40 |  |
| 2.48 CHINA GOVT 280925 | 18,000,000.00 | 18,357,886.80 |  |
| 2.5 CHINA GOVT 270725  | 61,000,000.00 | 62,189,524.40 |  |
| 2.52 CHINA GOVT 330825 | 74,000,000.00 | 75,333,221.00 |  |
| 2.54 CHINA GOVT 301225 | 65,000,000.00 | 66,670,370.00 |  |
| 2.55 CHINA GOVT 281015 | 50,000,000.00 | 51,156,895.00 |  |
| 2.6 CHINA GOVT 300915  | 52,000,000.00 | 53,474,642.00 |  |
| 2.6 CHINA GOVT 320901  | 37,000,000.00 | 38,020,349.00 |  |
| 2.62 CHINA GOVT 280415 | 71,000,000.00 | 72,772,997.80 |  |
| 2.62 CHINA GOVT 290925 | 29,000,000.00 | 29,840,614.30 |  |
| 2.62 CHINA GOVT 300625 | 60,000,000.00 | 61,753,080.00 |  |
| 2.64 CHINA GOVT 280115 | 41,000,000.00 | 42,004,372.90 |  |
| 2.67 CHINA GOVT 330525 | 52,000,000.00 | 53,784,270.80 |  |
| 2.67 CHINA GOVT 331125 | 49,000,000.00 | 50,491,192.50 |  |
| 2.68 CHINA GOVT 300521 | 55,000,000.00 | 56,785,212.00 |  |
| 2.69 CHINA GOVT 260812 | 34,000,000.00 | 34,705,850.20 |  |
| 2.69 CHINA GOVT 320815 | 48,000,000.00 | 49,653,187.20 |  |
| 2.74 CHINA GOVT 260804 | 24,000,000.00 | 24,520,984.80 |  |
| 2.75 CHINA GOVT 290615 | 30,000,000.00 | 31,057,944.00 |  |
| 2.75 CHINA GOVT 320217 | 30,000,000.00 | 31,209,000.00 |  |
| 2.76 CHINA GOVT 320515 | 37,000,000.00 | 38,495,654.70 |  |
| 2.79 CHINA GOVT 291215 | 31,000,000.00 | 32,185,638.40 |  |
| 2.8 CHINA GOVT 290324  | 62,000,000.00 | 64,228,732.60 |  |
| 2.8 CHINA GOVT 300325  | 45,000,000.00 | 46,722,672.00 |  |
| 2.8 CHINA GOVT 321115  | 29,000,000.00 | 30,250,422.00 |  |
| 2.85 CHINA GOVT 270604 | 57,000,000.00 | 58,696,320.00 |  |
| 2.88 CHINA GOVT 330225 | 36,000,000.00 | 37,784,138.40 |  |
| 2.89 CHINA GOVT 311118 | 27,000,000.00 | 28,367,512.20 |  |
| 2.9 CHINA GOVT 260505  | 24,000,000.00 | 24,565,274.40 |  |
| 2.91 CHINA GOVT 281014 | 32,000,000.00 | 33,225,404.80 |  |
| 2.99 CHINA GOVT 251015 | 39,000,000.00 | 39,701,968.80 |  |
| 3 CHINA GOVT 531015    | 25,000,000.00 | 27,795,037.50 |  |
|                        | 39,000,000.00 | 40,597,900.20 |  |

|       |      |                        |                  |                                      |  |
|-------|------|------------------------|------------------|--------------------------------------|--|
|       |      | 3.01 CHINA GOVT 280513 |                  |                                      |  |
|       |      | 3.02 CHINA GOVT 251022 | 36,000,000.00    | 36,665,996.40                        |  |
|       |      | 3.02 CHINA GOVT 310527 | 60,000,000.00    | 63,538,470.00                        |  |
|       |      | 3.03 CHINA GOVT 260311 | 28,000,000.00    | 28,667,312.80                        |  |
|       |      | 3.12 CHINA GOVT 261205 | 37,000,000.00    | 38,153,993.00                        |  |
|       |      | 3.12 CHINA GOVT 521025 | 22,000,000.00    | 24,803,565.60                        |  |
|       |      | 3.13 CHINA GOVT 291121 | 37,000,000.00    | 39,136,872.10                        |  |
|       |      | 3.19 CHINA GOVT 530415 | 20,000,000.00    | 22,841,514.00                        |  |
|       |      | 3.22 CHINA GOVT 251206 | 18,000,000.00    | 18,420,289.20                        |  |
|       |      | 3.25 CHINA GOVT 260606 | 28,000,000.00    | 28,877,643.20                        |  |
|       |      | 3.25 CHINA GOVT 281122 | 25,000,000.00    | 26,408,277.50                        |  |
|       |      | 3.27 CHINA GOVT 301119 | 35,000,000.00    | 37,614,675.00                        |  |
|       |      | 3.28 CHINA GOVT 271203 | 24,000,000.00    | 25,190,220.00                        |  |
|       |      | 3.29 CHINA GOVT 290523 | 29,000,000.00    | 30,874,789.10                        |  |
|       |      | 3.32 CHINA GOVT 520415 | 21,000,000.00    | 24,479,611.80                        |  |
|       |      | 3.39 CHINA GOVT 500316 | 43,000,000.00    | 50,311,758.70                        |  |
|       |      | 3.52 CHINA GOVT 270504 | 7,000,000.00     | 7,377,744.50                         |  |
|       |      | 3.53 CHINA GOVT 511018 | 31,000,000.00    | 37,359,941.40                        |  |
|       |      | 3.54 CHINA GOVT 280816 | 13,000,000.00    | 13,908,367.20                        |  |
|       |      | 3.59 CHINA GOVT 270803 | 7,000,000.00     | 7,406,968.10                         |  |
|       |      | 3.6 CHINA GOVT 250906  | 8,000,000.00     | 8,202,831.20                         |  |
|       |      | 3.69 CHINA GOVT 280517 | 15,000,000.00    | 16,183,551.00                        |  |
|       |      | 3.72 CHINA GOVT 510412 | 23,000,000.00    | 28,497,462.30                        |  |
|       |      | 3.81 CHINA GOVT 500914 | 45,000,000.00    | 56,355,088.50                        |  |
|       |      | 3.86 CHINA GOVT 490722 | 33,000,000.00    | 41,457,830.70                        |  |
|       |      | 4.08 CHINA GOVT 481022 | 29,000,000.00    | 37,542,005.10                        |  |
| 中国元合計 |      |                        | 2,979,000,000.00 | 3,108,585,618.00<br>(67,797,941,470) |  |
| ユーロ   | 国債証券 | 0 AUSTRIA GOVT 281020  | 1,790,000.00     | 1,597,080.96                         |  |
|       |      | 0 AUSTRIA GOVT 300220  | 3,100,000.00     | 2,663,223.94                         |  |
|       |      | 0 AUSTRIA GOVT 310220  | 2,720,000.00     | 2,268,888.00                         |  |
|       |      | 0 AUSTRIA GOVT 401020  | 1,170,000.00     | 708,212.11                           |  |
|       |      | 0 BEL GOVT 271022      | 1,800,000.00     | 1,648,308.60                         |  |
|       |      | 0 BEL GOVT 311022      | 2,300,000.00     | 1,880,763.74                         |  |
|       |      | 0 BUND 260815          | 5,930,000.00     | 5,617,685.69                         |  |
|       |      | 0 BUND 271115          | 3,100,000.00     | 2,858,095.37                         |  |
|       |      | 0 BUND 281115          | 5,500,000.00     | 4,969,604.74                         |  |
|       |      | 0 BUND 290815          | 4,550,000.00     | 4,044,873.78                         |  |
|       |      | 0 BUND 300215          | 4,820,000.00     | 4,237,482.08                         |  |
|       |      | 0 BUND 300815          | 6,660,000.00     | 5,793,892.30                         |  |
|       |      | 0 BUND 300815          | 1,550,000.00     | 1,349,467.77                         |  |
|       |      | 0 BUND 310215          | 5,140,000.00     | 4,422,578.06                         |  |
|       |      | 0 BUND 310815          | 5,400,000.00     | 4,594,212.00                         |  |

|                          |               |              |  |
|--------------------------|---------------|--------------|--|
| 0 BUND 310815            | 1,900,000.00  | 1,617,119.75 |  |
| 0 BUND 320215            | 4,690,000.00  | 3,940,146.38 |  |
| 0 BUND 350515            | 3,630,000.00  | 2,791,610.66 |  |
| 0 BUND 360515            | 4,270,000.00  | 3,187,879.52 |  |
| 0 BUND 500815            | 7,470,000.00  | 3,844,424.28 |  |
| 0 BUND 500815            | 1,560,000.00  | 805,214.28   |  |
| 0 BUND 520815            | 5,550,000.00  | 2,723,068.65 |  |
| 0 FINNISH GOVT 260915    | 1,800,000.00  | 1,693,995.30 |  |
| 0 FINNISH GOVT 300915    | 750,000.00    | 633,950.01   |  |
| 0 IRISH GOVT 311018      | 1,900,000.00  | 1,568,493.70 |  |
| 0 ITALY GOVT 260401      | 3,300,000.00  | 3,131,168.70 |  |
| 0 ITALY GOVT 260801      | 5,000,000.00  | 4,699,328.75 |  |
| 0 NETH GOVT 260115       | 2,200,000.00  | 2,108,315.00 |  |
| 0 NETH GOVT 270115       | 1,950,000.00  | 1,825,209.75 |  |
| 0 NETH GOVT 290115       | 2,380,000.00  | 2,121,008.40 |  |
| 0 NETH GOVT 300715       | 2,650,000.00  | 2,273,872.25 |  |
| 0 NETH GOVT 310715       | 2,540,000.00  | 2,125,217.77 |  |
| 0 NETH GOVT 380115       | 2,280,000.00  | 1,562,381.40 |  |
| 0 NETH GOVT 520115       | 3,690,000.00  | 1,763,344.90 |  |
| 0 O.A.T 260225           | 7,790,000.00  | 7,430,325.96 |  |
| 0 O.A.T 270225           | 8,240,000.00  | 7,654,749.88 |  |
| 0 O.A.T 291125           | 8,130,000.00  | 7,007,090.74 |  |
| 0 O.A.T 301125           | 9,640,000.00  | 8,067,913.61 |  |
| 0 O.A.T 311125           | 10,700,000.00 | 8,675,774.00 |  |
| 0 O.A.T 320525           | 6,030,000.00  | 4,809,739.05 |  |
| 0 OBL 251010             | 4,000,000.00  | 3,859,095.68 |  |
| 0 OBL 251010             | 1,000,000.00  | 965,462.97   |  |
| 0 OBL 260410             | 6,910,000.00  | 6,594,048.88 |  |
| 0 OBL 261009             | 2,900,000.00  | 2,737,072.92 |  |
| 0 OBL 270416             | 3,830,000.00  | 3,575,640.12 |  |
| 0 SPAIN GOVT 260131      | 3,000,000.00  | 2,865,493.86 |  |
| 0 SPAIN GOVT 270131      | 9,400,000.00  | 8,742,749.64 |  |
| 0 SPAIN GOVT 280131      | 5,320,000.00  | 4,819,022.55 |  |
| 0.1 BEL GOVT 300622      | 3,020,000.00  | 2,586,953.89 |  |
| 0.1 SPAIN GOVT 310430    | 4,360,000.00  | 3,616,903.40 |  |
| 0.125 FINNISH GOV 310915 | 1,070,000.00  | 885,394.67   |  |
| 0.125 FINNISH GOV 360415 | 1,120,000.00  | 801,141.60   |  |
| 0.125 FINNISH GOV 520415 | 750,000.00    | 346,845.00   |  |
| 0.2 IRISH GOVT 270515    | 500,000.00    | 466,395.00   |  |
| 0.2 IRISH GOVT 301018    | 2,130,000.00  | 1,836,940.60 |  |
| 0.25 AUSTRIA GOVT 361020 | 1,490,000.00  | 1,070,156.74 |  |
| 0.25 BUND 280815         | 4,640,000.00  | 4,260,934.03 |  |
|                          | 4,850,000.00  | 4,413,498.78 |  |

|                          |               |              |  |
|--------------------------|---------------|--------------|--|
| 0.25 BUND 290215         |               |              |  |
| 0.25 FINNISH GOVT 400915 | 940,000.00    | 600,429.56   |  |
| 0.25 ITALY GOVT 280315   | 4,760,000.00  | 4,299,436.68 |  |
| 0.25 NETH GOVT 250715    | 3,290,000.00  | 3,199,732.00 |  |
| 0.25 NETH GOVT 290715    | 2,950,000.00  | 2,632,370.55 |  |
| 0.25 O.A.T 261125        | 7,360,000.00  | 6,924,654.16 |  |
| 0.35 BEL GOVT 320622     | 2,940,000.00  | 2,422,193.23 |  |
| 0.35 IRISH GOVT 321018   | 800,000.00    | 662,339.40   |  |
| 0.4 BEL GOVT 400622      | 1,660,000.00  | 1,070,233.25 |  |
| 0.4 IRISH GOVT 350515    | 1,020,000.00  | 790,423.50   |  |
| 0.45 ITALY GOVT 290215   | 2,300,000.00  | 2,038,746.45 |  |
| 0.5 AUSTRIA GOVT 270420  | 2,100,000.00  | 1,976,641.80 |  |
| 0.5 AUSTRIA GOVT 290220  | 2,050,000.00  | 1,856,078.20 |  |
| 0.5 BUND 260215          | 6,660,000.00  | 6,426,626.94 |  |
| 0.5 BUND 270815          | 5,120,000.00  | 4,824,558.08 |  |
| 0.5 BUND 280215          | 4,280,000.00  | 4,001,866.34 |  |
| 0.5 FINNISH GOVT 260415  | 1,670,000.00  | 1,603,191.65 |  |
| 0.5 FINNISH GOVT 270915  | 700,000.00    | 653,623.07   |  |
| 0.5 FINNISH GOVT 280915  | 1,480,000.00  | 1,351,996.65 |  |
| 0.5 FINNISH GOVT 290915  | 1,350,000.00  | 1,205,616.82 |  |
| 0.5 FINNISH GOVT 430415  | 780,000.00    | 492,352.38   |  |
| 0.5 ITALY GOVT 260201    | 2,450,000.00  | 2,353,485.31 |  |
| 0.5 ITALY GOVT 280715    | 2,400,000.00  | 2,169,084.60 |  |
| 0.5 NETH GOVT 260715     | 3,970,000.00  | 3,800,143.55 |  |
| 0.5 NETH GOVT 320715     | 2,300,000.00  | 1,952,760.42 |  |
| 0.5 NETH GOVT 400115     | 2,630,000.00  | 1,867,487.38 |  |
| 0.5 O.A.T 260525         | 10,240,000.00 | 9,796,784.64 |  |
| 0.5 O.A.T 290525         | 10,330,000.00 | 9,254,306.11 |  |
| 0.5 O.A.T 400525         | 4,680,000.00  | 3,070,833.48 |  |
| 0.5 O.A.T 440625         | 3,890,000.00  | 2,286,001.29 |  |
| 0.5 O.A.T 720525         | 2,310,000.00  | 864,430.87   |  |
| 0.5 SPAIN GOVT 300430    | 4,580,000.00  | 4,014,141.00 |  |
| 0.5 SPAIN GOVT 311031    | 4,340,000.00  | 3,655,039.50 |  |
| 0.55 IRISH GOVT 410422   | 600,000.00    | 406,756.80   |  |
| 0.6 ITALY GOVT 310801    | 3,100,000.00  | 2,566,676.00 |  |
| 0.6 SPAIN GOVT 291031    | 3,680,000.00  | 3,281,104.56 |  |
| 0.65 BEL GOVT 710622     | 1,090,000.00  | 463,446.20   |  |
| 0.7 AUSTRIA GOVT 710420  | 680,000.00    | 306,455.60   |  |
| 0.7 SPAIN GOVT 320430    | 3,800,000.00  | 3,207,922.00 |  |
| 0.75 AUSTRIA GOVT 261020 | 2,480,000.00  | 2,371,193.10 |  |
| 0.75 AUSTRIA GOVT 280220 | 2,940,000.00  | 2,743,531.56 |  |
| 0.75 AUSTRIA GOVT 510320 | 1,570,000.00  | 906,298.20   |  |
| 0.75 FINNISH GOVT 310415 | 1,050,000.00  | 919,781.36   |  |

|                          |               |               |  |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| 0.75 NETH GOVT 270715    | 4,170,000.00  | 3,947,369.95  |  |
| 0.75 NETH GOVT 280715    | 3,020,000.00  | 2,810,233.82  |  |
| 0.75 O.A.T 280225        | 11,000,000.00 | 10,229,565.50 |  |
| 0.75 O.A.T 280525        | 9,750,000.00  | 9,025,965.00  |  |
| 0.75 O.A.T 281125        | 10,340,000.00 | 9,473,218.48  |  |
| 0.75 O.A.T 520525        | 5,560,000.00  | 2,903,126.20  |  |
| 0.75 O.A.T 530525        | 5,390,000.00  | 2,745,143.17  |  |
| 0.8 BEL GOVT 270622      | 2,880,000.00  | 2,724,642.00  |  |
| 0.8 BEL GOVT 280622      | 2,740,000.00  | 2,549,134.34  |  |
| 0.8 SPAIN GOVT 270730    | 4,670,000.00  | 4,394,752.53  |  |
| 0.8 SPAIN GOVT 290730    | 5,430,000.00  | 4,915,710.41  |  |
| 0.85 AUSTRIA GOVT 200630 | 830,000.00    | 378,814.90    |  |
| 0.85 ITALY GOVT 270115   | 3,060,000.00  | 2,900,642.32  |  |
| 0.85 SPAIN GOVT 370730   | 2,470,000.00  | 1,816,428.12  |  |
| 0.875 FINNISH GOV 250915 | 630,000.00    | 614,314.96    |  |
| 0.9 AUSTRIA GOVT 320220  | 2,120,000.00  | 1,844,042.78  |  |
| 0.9 BEL GOVT 290622      | 3,090,000.00  | 2,835,788.79  |  |
| 0.9 IRISH GOVT 280515    | 1,640,000.00  | 1,538,399.13  |  |
| 0.9 ITALY GOVT 310401    | 4,230,000.00  | 3,612,390.39  |  |
| 0.95 ITALY GOVT 270915   | 4,000,000.00  | 3,749,525.00  |  |
| 0.95 ITALY GOVT 300801   | 2,940,000.00  | 2,564,229.78  |  |
| 0.95 ITALY GOVT 311201   | 4,330,000.00  | 3,646,163.10  |  |
| 0.95 ITALY GOVT 320601   | 2,800,000.00  | 2,324,168.00  |  |
| 0.95 ITALY GOVT 370301   | 3,020,000.00  | 2,158,575.20  |  |
| 1 BEL GOVT 260622        | 2,760,000.00  | 2,665,007.70  |  |
| 1 BEL GOVT 310622        | 3,430,000.00  | 3,046,841.56  |  |
| 1 BUND 250815            | 5,580,000.00  | 5,461,083.22  |  |
| 1 BUND 380515            | 3,810,000.00  | 3,114,497.83  |  |
| 1 IRISH GOVT 260515      | 1,850,000.00  | 1,789,777.87  |  |
| 1 O.A.T 251125           | 6,580,000.00  | 6,401,471.44  |  |
| 1 O.A.T 270525           | 7,540,000.00  | 7,163,352.04  |  |
| 1 SPAIN GOVT 420730      | 2,070,000.00  | 1,372,381.02  |  |
| 1 SPAIN GOVT 501031      | 3,650,000.00  | 2,025,321.12  |  |
| 1.1 IRISH GOVT 290515    | 1,610,000.00  | 1,499,461.26  |  |
| 1.1 ITALY GOVT 270401    | 3,300,000.00  | 3,134,276.04  |  |
| 1.125 FINNISH GOV 340415 | 730,000.00    | 621,048.50    |  |
| 1.2 AUSTRIA GOVT 251020  | 2,710,000.00  | 2,648,071.08  |  |
| 1.2 ITALY GOVT 250815    | 2,100,000.00  | 2,054,140.20  |  |
| 1.2 SPAIN GOVT 401031    | 3,400,000.00  | 2,422,347.00  |  |
| 1.25 BEL GOVT 330422     | 1,770,000.00  | 1,551,896.17  |  |
| 1.25 BUND 480815         | 6,260,000.00  | 4,745,818.35  |  |
| 1.25 ITALY GOVT 261201   | 4,080,000.00  | 3,915,665.76  |  |
|                          |               |               |  |

|                          |               |               |
|--------------------------|---------------|---------------|
| 1.25 O.A.T 340525        | 9,110,000.00  | 7,730,563.80  |
| 1.25 O.A.T 360525        | 7,890,000.00  | 6,415,529.34  |
| 1.25 O.A.T 380525        | 4,620,000.00  | 3,587,857.35  |
| 1.25 SPAIN GOVT 301031   | 4,930,000.00  | 4,470,526.46  |
| 1.3 IRISH GOVT 330515    | 860,000.00    | 764,338.00    |
| 1.3 OBL 271015           | 5,750,000.00  | 5,542,984.18  |
| 1.3 OBL 271015           | 800,000.00    | 771,341.80    |
| 1.3 SPAIN GOVT 261031    | 4,750,000.00  | 4,586,050.18  |
| 1.35 IRISH GOVT 310318   | 1,070,000.00  | 986,824.08    |
| 1.35 ITALY GOVT 300401   | 3,610,000.00  | 3,255,137.00  |
| 1.375 FINNISH GOV 270415 | 800,000.00    | 771,042.00    |
| 1.375 FINNISH GOV 470415 | 990,000.00    | 713,749.65    |
| 1.4 BEL GOVT 530622      | 2,040,000.00  | 1,280,206.08  |
| 1.4 SPAIN GOVT 280430    | 4,660,000.00  | 4,426,232.07  |
| 1.4 SPAIN GOVT 280730    | 4,240,000.00  | 4,014,993.80  |
| 1.45 BEL GOVT 370622     | 1,220,000.00  | 1,001,632.20  |
| 1.45 ITALY GOVT 360301   | 2,440,000.00  | 1,912,062.08  |
| 1.45 SPAIN GOVT 271031   | 4,330,000.00  | 4,145,116.57  |
| 1.45 SPAIN GOVT 290430   | 4,280,000.00  | 4,022,874.72  |
| 1.45 SPAIN GOVT 711031   | 1,300,000.00  | 649,915.50    |
| 1.5 AUSTRIA GOVT 470220  | 1,810,000.00  | 1,328,675.75  |
| 1.5 AUSTRIA GOVT 861102  | 460,000.00    | 277,527.20    |
| 1.5 FINNISH GOVT 320915  | 750,000.00    | 677,326.87    |
| 1.5 IRISH GOVT 500515    | 1,460,000.00  | 1,051,495.65  |
| 1.5 ITALY GOVT 450430    | 2,880,000.00  | 1,858,147.20  |
| 1.5 O.A.T 310525         | 11,340,000.00 | 10,393,246.08 |
| 1.5 O.A.T 500525         | 6,180,000.00  | 4,128,326.52  |
| 1.5 SPAIN GOVT 270430    | 4,290,000.00  | 4,136,092.47  |
| 1.6 BEL GOVT 470622      | 1,800,000.00  | 1,289,237.40  |
| 1.6 ITALY GOVT 260601    | 4,120,000.00  | 4,010,506.88  |
| 1.65 ITALY GOVT 301201   | 3,870,000.00  | 3,498,644.47  |
| 1.65 ITALY GOVT 320301   | 4,450,000.00  | 3,931,753.00  |
| 1.7 BEL GOVT 500622      | 1,840,000.00  | 1,295,045.37  |
| 1.7 BUND 320815          | 5,530,000.00  | 5,272,249.46  |
| 1.7 IRISH GOVT 370515    | 1,190,000.00  | 1,033,069.94  |
| 1.7 ITALY GOVT 510901    | 2,900,000.00  | 1,792,272.50  |
| 1.75 O.A.T 390625        | 5,830,000.00  | 4,797,696.47  |
| 1.75 O.A.T 660525        | 2,970,000.00  | 1,907,634.71  |
| 1.8 BUND 530815          | 5,030,000.00  | 4,205,155.45  |
| 1.8 BUND 530815          | 1,300,000.00  | 1,088,738.61  |
| 1.8 ITALY GOVT 410301    | 2,950,000.00  | 2,162,543.22  |
| 1.85 AUSTRIA GOVT 490523 | 1,130,000.00  | 878,135.43    |
| 1.85 ITALY GOVT 250701   | 4,650,000.00  | 4,588,044.56  |

|                         |              |              |  |
|-------------------------|--------------|--------------|--|
| 1.85 SPAIN GOVT 350730  | 5,000,000.00 | 4,368,885.00 |  |
| 1.9 BEL GOVT 380622     | 1,360,000.00 | 1,161,506.30 |  |
| 1.9 SPAIN GOVT 521031   | 3,170,000.00 | 2,164,206.55 |  |
| 1.95 SPAIN GOVT 260430  | 3,520,000.00 | 3,459,092.98 |  |
| 1.95 SPAIN GOVT 300730  | 3,790,000.00 | 3,602,314.46 |  |
| 2 AUSTRIA GOVT 260715   | 1,000,000.00 | 984,360.00   |  |
| 2 IRISH GOVT 450218     | 1,970,000.00 | 1,655,642.17 |  |
| 2 ITALY GOVT 251201     | 3,530,000.00 | 3,476,458.72 |  |
| 2 ITALY GOVT 280201     | 3,880,000.00 | 3,743,365.80 |  |
| 2 NETH GOVT 540115      | 2,030,000.00 | 1,700,995.87 |  |
| 2 O.A.T 321125          | 7,450,000.00 | 6,928,596.85 |  |
| 2 O.A.T 480525          | 4,970,000.00 | 3,808,202.86 |  |
| 2.05 ITALY GOVT 270801  | 2,650,000.00 | 2,574,245.77 |  |
| 2.1 AUSTRIA GOVT 170920 | 950,000.00   | 715,523.85   |  |
| 2.1 BUND 291115         | 4,460,000.00 | 4,395,069.09 |  |
| 2.1 ITALY GOVT 260715   | 2,350,000.00 | 2,306,654.25 |  |
| 2.1 OBL 290412          | 4,560,000.00 | 4,497,386.64 |  |
| 2.1 OBL 290412          | 900,000.00   | 887,884.92   |  |
| 2.15 BEL GOVT 660622    | 1,530,000.00 | 1,135,930.14 |  |
| 2.15 ITALY GOVT 520901  | 1,550,000.00 | 1,044,162.15 |  |
| 2.15 ITALY GOVT 720301  | 1,410,000.00 | 872,405.77   |  |
| 2.15 SPAIN GOVT 251031  | 8,000,000.00 | 7,906,758.00 |  |
| 2.2 BUND 340215         | 5,650,000.00 | 5,549,966.75 |  |
| 2.2 ITALY GOVT 270601   | 3,380,000.00 | 3,303,630.59 |  |
| 2.2 OBL 280413          | 4,250,000.00 | 4,211,813.75 |  |
| 2.25 BEL GOVT 570622    | 1,300,000.00 | 994,275.77   |  |
| 2.25 ITALY GOVT 360901  | 3,170,000.00 | 2,698,842.90 |  |
| 2.3 BUND 330215         | 6,190,000.00 | 6,157,841.40 |  |
| 2.3 BUND 330215         | 1,670,000.00 | 1,662,102.98 |  |
| 2.35 SPAIN GOVT 330730  | 4,090,000.00 | 3,858,874.10 |  |
| 2.4 AUSTRIA GOVT 340523 | 1,690,000.00 | 1,616,168.12 |  |
| 2.4 BUND 301115         | 3,380,000.00 | 3,383,608.15 |  |
| 2.4 IRISH GOVT 300515   | 1,490,000.00 | 1,470,136.43 |  |
| 2.4 OBL 281019          | 4,820,000.00 | 4,814,407.97 |  |
| 2.45 ITALY GOVT 330901  | 3,420,000.00 | 3,130,862.94 |  |
| 2.45 ITALY GOVT 500901  | 2,750,000.00 | 2,017,141.50 |  |
| 2.5 BUND 440704         | 5,360,000.00 | 5,240,183.90 |  |
| 2.5 BUND 460815         | 5,660,000.00 | 5,527,256.02 |  |
| 2.5 BUND 540815         | 2,640,000.00 | 2,575,085.04 |  |
| 2.5 ITALY GOVT 251115   | 2,330,000.00 | 2,310,828.17 |  |
| 2.5 ITALY GOVT 321201   | 3,950,000.00 | 3,668,878.50 |  |
| 2.5 NETH GOVT 300115    | 1,900,000.00 | 1,890,025.00 |  |
|                         |              |              |  |

|                          |               |               |
|--------------------------|---------------|---------------|
| 2.5 NETH GOVT 330115     | 2,750,000.00  | 2,723,311.25  |
| 2.5 NETH GOVT 330715     | 1,910,000.00  | 1,885,043.46  |
| 2.5 NETH GOVT 340715     | 1,500,000.00  | 1,472,741.24  |
| 2.5 O.A.T 260924         | 8,300,000.00  | 8,226,943.40  |
| 2.5 O.A.T 270924         | 2,800,000.00  | 2,770,467.00  |
| 2.5 O.A.T 300525         | 11,270,000.00 | 11,069,608.91 |
| 2.5 O.A.T 430525         | 3,230,000.00  | 2,823,136.28  |
| 2.5 SCHATS 260319        | 2,500,000.00  | 2,486,520.62  |
| 2.5 SPAIN GOVT 270531    | 2,200,000.00  | 2,176,520.50  |
| 2.55 SPAIN GOVT 321031   | 4,360,000.00  | 4,211,285.85  |
| 2.6 BUND 330815          | 5,310,000.00  | 5,402,425.86  |
| 2.6 IRISH GOVT 341018    | 850,000.00    | 834,356.17    |
| 2.625 FINNISH GOV 420704 | 940,000.00    | 875,266.12    |
| 2.65 ITALY GOVT 271201   | 2,800,000.00  | 2,764,216.00  |
| 2.7 BEL GOVT 291022      | 800,000.00    | 798,516.20    |
| 2.7 ITALY GOVT 470301    | 3,300,000.00  | 2,625,159.90  |
| 2.7 SPAIN GOVT 481031    | 3,670,000.00  | 3,097,356.42  |
| 2.75 BEL GOVT 390422     | 1,350,000.00  | 1,272,421.91  |
| 2.75 FINNISH GOVT 280704 | 1,110,000.00  | 1,112,405.70  |
| 2.75 FINNISH GOVT 380415 | 680,000.00    | 652,566.59    |
| 2.75 NETH GOVT 470115    | 3,320,000.00  | 3,280,276.20  |
| 2.75 O.A.T 271025        | 10,320,000.00 | 10,289,029.68 |
| 2.75 O.A.T 290225        | 8,700,000.00  | 8,665,141.27  |
| 2.75 O.A.T 300225        | 1,950,000.00  | 1,938,835.27  |
| 2.8 ITALY GOVT 281201    | 3,680,000.00  | 3,635,827.12  |
| 2.8 ITALY GOVT 290615    | 3,200,000.00  | 3,144,699.20  |
| 2.8 ITALY GOVT 670301    | 1,510,000.00  | 1,122,863.18  |
| 2.8 SPAIN GOVT 260531    | 3,500,000.00  | 3,488,480.62  |
| 2.85 BEL GOVT 341022     | 1,850,000.00  | 1,826,205.30  |
| 2.875 FINNISH GOV 290415 | 600,000.00    | 603,478.98    |
| 2.9 AUSTRIA GOVT 290523  | 700,000.00    | 705,410.44    |
| 2.9 AUSTRIA GOVT 330220  | 2,710,000.00  | 2,714,654.96  |
| 2.9 AUSTRIA GOVT 340220  | 1,470,000.00  | 1,467,638.81  |
| 2.9 SCHATS 260618        | 2,500,000.00  | 2,506,006.00  |
| 2.9 SPAIN GOVT 461031    | 3,540,000.00  | 3,138,741.00  |
| 2.95 FINNISH GOVT 550415 | 670,000.00    | 643,360.46    |
| 2.95 ITALY GOVT 270215   | 830,000.00    | 827,437.17    |
| 2.95 ITALY GOVT 380901   | 2,730,000.00  | 2,442,577.41  |
| 3 BEL GOVT 330622        | 2,750,000.00  | 2,772,409.75  |
| 3 BEL GOVT 340622        | 2,050,000.00  | 2,057,635.22  |
| 3 FINNISH GOVT 330915    | 1,720,000.00  | 1,734,357.69  |
| 3 FINNISH GOVT 340915    | 700,000.00    | 703,608.50    |
| 3 IRISH GOVT 431018      | 690,000.00    | 684,518.99    |

|                          |              |              |  |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| 3 ITALY GOVT 290801      | 5,420,000.00 | 5,375,718.60 |  |
| 3 O.A.T 330525           | 6,680,000.00 | 6,684,328.64 |  |
| 3 O.A.T 341125           | 1,650,000.00 | 1,637,018.62 |  |
| 3 O.A.T 490625           | 1,080,000.00 | 999,633.15   |  |
| 3 O.A.T 540525           | 4,370,000.00 | 3,936,978.88 |  |
| 3.1 ITALY GOVT 400301    | 2,310,000.00 | 2,069,298.00 |  |
| 3.1 SCHATS 251212        | 4,000,000.00 | 4,008,018.00 |  |
| 3.15 AUSTRIA GOVT 440620 | 1,250,000.00 | 1,245,457.18 |  |
| 3.15 AUSTRIA GOVT 531020 | 1,070,000.00 | 1,061,961.09 |  |
| 3.15 SPAIN GOVT 330430   | 4,400,000.00 | 4,427,962.00 |  |
| 3.2 AUSTRIA GOVT 390715  | 400,000.00   | 403,035.20   |  |
| 3.2 ITALY GOVT 260128    | 4,450,000.00 | 4,449,782.92 |  |
| 3.25 BUND 420704         | 3,640,000.00 | 3,954,587.00 |  |
| 3.25 ITALY GOVT 380301   | 2,220,000.00 | 2,062,158.00 |  |
| 3.25 ITALY GOVT 460901   | 2,740,000.00 | 2,400,557.84 |  |
| 3.25 NETH GOVT 440115    | 1,330,000.00 | 1,404,900.28 |  |
| 3.25 O.A.T 450525        | 5,600,000.00 | 5,463,161.20 |  |
| 3.25 O.A.T 550525        | 2,330,000.00 | 2,193,558.10 |  |
| 3.25 SPAIN GOVT 340430   | 3,710,000.00 | 3,739,787.59 |  |
| 3.3 BEL GOVT 540622      | 1,690,000.00 | 1,624,630.80 |  |
| 3.35 ITALY GOVT 290701   | 1,400,000.00 | 1,409,033.08 |  |
| 3.35 ITALY GOVT 350301   | 3,110,000.00 | 3,009,741.37 |  |
| 3.4 ITALY GOVT 280401    | 3,000,000.00 | 3,032,280.00 |  |
| 3.45 AUSTRIA GOVT 301020 | 910,000.00   | 944,959.01   |  |
| 3.45 BEL GOVT 430622     | 770,000.00   | 779,293.90   |  |
| 3.45 ITALY GOVT 310715   | 600,000.00   | 601,370.40   |  |
| 3.45 ITALY GOVT 480301   | 3,470,000.00 | 3,115,426.72 |  |
| 3.45 SPAIN GOVT 341031   | 500,000.00   | 510,926.35   |  |
| 3.45 SPAIN GOVT 430730   | 2,460,000.00 | 2,394,560.90 |  |
| 3.45 SPAIN GOVT 660730   | 2,800,000.00 | 2,582,879.60 |  |
| 3.5 BEL GOVT 550622      | 1,180,000.00 | 1,172,140.02 |  |
| 3.5 ITALY GOVT 260115    | 2,500,000.00 | 2,511,190.75 |  |
| 3.5 ITALY GOVT 300301    | 4,470,000.00 | 4,533,596.92 |  |
| 3.5 ITALY GOVT 310215    | 2,590,000.00 | 2,609,554.50 |  |
| 3.5 O.A.T 260425         | 6,690,000.00 | 6,751,293.78 |  |
| 3.5 O.A.T 331125         | 8,080,000.00 | 8,383,704.56 |  |
| 3.5 SPAIN GOVT 290531    | 3,380,000.00 | 3,480,126.07 |  |
| 3.55 SPAIN GOVT 331031   | 4,120,000.00 | 4,263,772.33 |  |
| 3.6 ITALY GOVT 250929    | 2,000,000.00 | 2,007,429.00 |  |
| 3.7 ITALY GOVT 300615    | 2,350,000.00 | 2,398,686.12 |  |
| 3.75 BEL GOVT 450622     | 1,840,000.00 | 1,936,912.06 |  |
| 3.75 NETH GOVT 420115    | 3,240,000.00 | 3,630,823.38 |  |
|                          |              |              |  |

|                          |              |              |
|--------------------------|--------------|--------------|
| 3.8 AUSTRIA GOVT 620126  | 1,050,000.00 | 1,198,593.37 |
| 3.8 ITALY GOVT 260415    | 2,700,000.00 | 2,730,623.40 |
| 3.8 ITALY GOVT 280801    | 3,090,000.00 | 3,169,513.42 |
| 3.85 ITALY GOVT 260915   | 2,800,000.00 | 2,844,383.36 |
| 3.85 ITALY GOVT 291215   | 3,890,000.00 | 4,006,194.30 |
| 3.85 ITALY GOVT 340701   | 2,020,000.00 | 2,048,740.56 |
| 3.85 ITALY GOVT 490901   | 2,450,000.00 | 2,326,397.50 |
| 3.9 SPAIN GOVT 390730    | 2,390,000.00 | 2,499,928.05 |
| 4 BEL GOVT 320328        | 1,620,000.00 | 1,747,422.72 |
| 4 BUND 370104            | 4,830,000.00 | 5,576,955.62 |
| 4 FINNISH GOVT 250704    | 240,000.00   | 241,839.00   |
| 4 ITALY GOVT 301115      | 3,840,000.00 | 3,982,131.84 |
| 4 ITALY GOVT 311030      | 1,650,000.00 | 1,715,909.25 |
| 4 ITALY GOVT 350430      | 2,150,000.00 | 2,207,315.77 |
| 4 ITALY GOVT 370201      | 5,850,000.00 | 5,971,326.07 |
| 4 NETH GOVT 370115       | 3,160,000.00 | 3,555,055.30 |
| 4 O.A.T 381025           | 4,510,000.00 | 4,884,805.80 |
| 4 O.A.T 550425           | 3,330,000.00 | 3,617,329.05 |
| 4 O.A.T 600425           | 3,670,000.00 | 4,025,758.79 |
| 4 SPAIN GOVT 541031      | 1,300,000.00 | 1,340,729.00 |
| 4.05 ITALY GOVT 371030   | 2,200,000.00 | 2,236,641.00 |
| 4.1 ITALY GOVT 290201    | 3,530,000.00 | 3,668,822.54 |
| 4.15 AUSTRIA GOVT 370315 | 2,540,000.00 | 2,829,278.06 |
| 4.15 ITALY GOVT 391001   | 2,130,000.00 | 2,160,445.15 |
| 4.2 ITALY GOVT 340301    | 3,430,000.00 | 3,584,319.13 |
| 4.2 SPAIN GOVT 370131    | 4,260,000.00 | 4,640,536.42 |
| 4.25 BEL GOVT 410328     | 2,940,000.00 | 3,288,394.41 |
| 4.25 BUND 390704         | 3,810,000.00 | 4,577,629.27 |
| 4.35 ITALY GOVT 331101   | 3,710,000.00 | 3,926,816.11 |
| 4.4 ITALY GOVT 330501    | 3,800,000.00 | 4,044,889.10 |
| 4.45 ITALY GOVT 430901   | 1,940,000.00 | 2,017,394.36 |
| 4.5 BEL GOVT 260328      | 1,610,000.00 | 1,652,211.78 |
| 4.5 ITALY GOVT 260301    | 3,740,000.00 | 3,819,080.43 |
| 4.5 ITALY GOVT 531001    | 2,470,000.00 | 2,566,368.77 |
| 4.5 O.A.T 410425         | 6,620,000.00 | 7,595,887.30 |
| 4.65 SPAIN GOVT 250730   | 2,890,000.00 | 2,930,139.21 |
| 4.7 SPAIN GOVT 410730    | 3,450,000.00 | 3,955,218.00 |
| 4.75 BUND 280704         | 2,340,000.00 | 2,543,663.30 |
| 4.75 BUND 340704         | 4,890,000.00 | 5,887,819.17 |
| 4.75 BUND 400704         | 3,610,000.00 | 4,606,410.54 |
| 4.75 ITALY GOVT 280901   | 3,930,000.00 | 4,176,108.39 |
| 4.75 ITALY GOVT 440901   | 3,480,000.00 | 3,772,647.12 |
| 4.75 O.A.T 350425        | 5,130,000.00 | 5,894,411.04 |

|       |                          |                  |                                       |  |
|-------|--------------------------|------------------|---------------------------------------|--|
|       | 4.85 AUSTRIA GOVT 260315 | 1,370,000.00     | 1,411,358.65                          |  |
|       | 4.9 SPAIN GOVT 400730    | 4,370,000.00     | 5,094,962.01                          |  |
|       | 5 BEL GOVT 350328        | 3,280,000.00     | 3,858,998.39                          |  |
|       | 5 ITALY GOVT 340801      | 4,650,000.00     | 5,170,407.07                          |  |
|       | 5 ITALY GOVT 390801      | 5,170,000.00     | 5,737,730.62                          |  |
|       | 5 ITALY GOVT 400901      | 3,950,000.00     | 4,386,411.80                          |  |
|       | 5.15 SPAIN GOVT 281031   | 3,250,000.00     | 3,553,379.37                          |  |
|       | 5.15 SPAIN GOVT 441031   | 2,640,000.00     | 3,211,206.76                          |  |
|       | 5.25 ITALY GOVT 291101   | 5,160,000.00     | 5,677,927.26                          |  |
|       | 5.5 BEL GOVT 280328      | 4,910,000.00     | 5,380,029.39                          |  |
|       | 5.5 BUND 310104          | 3,650,000.00     | 4,319,514.73                          |  |
|       | 5.5 NETH GOVT 280115     | 2,180,000.00     | 2,385,579.45                          |  |
|       | 5.5 O.A.T 290425         | 6,800,000.00     | 7,593,393.40                          |  |
|       | 5.625 BUND 280104        | 3,460,000.00     | 3,818,488.17                          |  |
|       | 5.75 ITALY GOVT 330201   | 4,920,000.00     | 5,709,244.75                          |  |
|       | 5.75 O.A.T 321025        | 6,200,000.00     | 7,448,459.89                          |  |
|       | 5.75 SPAIN GOVT 320730   | 4,990,000.00     | 5,965,730.62                          |  |
|       | 5.9 SPAIN GOVT 260730    | 4,650,000.00     | 4,917,386.62                          |  |
|       | 6 ITALY GOVT 310501      | 5,600,000.00     | 6,504,117.20                          |  |
|       | 6 O.A.T 251025           | 760,000.00       | 786,725.02                            |  |
|       | 6 SPAIN GOVT 290131      | 4,230,000.00     | 4,800,603.73                          |  |
|       | 6.25 AUSTRIA GOVT 270715 | 1,630,000.00     | 1,792,555.01                          |  |
|       | 6.25 BUND 300104         | 1,700,000.00     | 2,031,970.90                          |  |
|       | 6.5 BUND 270704          | 2,680,000.00     | 2,979,009.47                          |  |
|       | 6.5 ITALY GOVT 271101    | 4,970,000.00     | 5,504,901.71                          |  |
|       | 7.25 ITALY GOVT 261101   | 2,300,000.00     | 2,511,926.60                          |  |
| ユーロ合計 |                          | 1,285,640,000.00 | 1,199,400,956.49<br>(207,232,497,262) |  |
| 合計    |                          |                  | 666,615,757,886<br>(666,615,757,886)  |  |

(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<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|------------|------------|--------------|-------------------------|
| アメリカドル     | 国債証券 271銘柄 | 100.00%      | 46.81%                  |
| カナダドル      | 国債証券 38銘柄  | 100.00%      | 1.92%                   |
| オーストラリアドル  | 国債証券 26銘柄  | 100.00%      | 1.30%                   |
| イギリスポンド    | 国債証券 60銘柄  | 100.00%      | 5.35%                   |
| シンガポールドル   | 国債証券 19銘柄  | 100.00%      | 0.40%                   |
| マレーシアリンギット | 国債証券 29銘柄  | 100.00%      | 0.49%                   |
| ニュージーランドドル | 国債証券 13銘柄  | 100.00%      | 0.24%                   |

|            |      |       |         |        |
|------------|------|-------|---------|--------|
| スウェーデンクローネ | 国債証券 | 7銘柄   | 100.00% | 0.16%  |
| ノルウェークローネ  | 国債証券 | 10銘柄  | 100.00% | 0.15%  |
| デンマーククローネ  | 国債証券 | 7銘柄   | 100.00% | 0.25%  |
| メキシコペソ     | 国債証券 | 15銘柄  | 100.00% | 0.81%  |
| イスラエルシェケル  | 国債証券 | 12銘柄  | 100.00% | 0.32%  |
| ポーランドズロチ   | 国債証券 | 13銘柄  | 100.00% | 0.55%  |
| 中国元        | 国債証券 | 77銘柄  | 100.00% | 10.17% |
| ユーロ        | 国債証券 | 381銘柄 | 100.00% | 31.09% |

## 第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

## ２【ファンドの現況】

### 【三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）】

#### 【純資産額計算書】

2024年 7月31日現在

（単位：円）

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 資産総額            | 1,031,331,097  |
| 負債総額            | 713,853        |
| 純資産総額（ - ）      | 1,030,617,244  |
| 発行済口数           | 1,054,121,206口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 0.9777         |
| （10,000口当たり）    | （9,777）        |

（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 7月31日現在

（単位：円）

|                 |                  |
|-----------------|------------------|
| 資産総額            | 656,256,655,600  |
| 負債総額            | 1,534,964,404    |
| 純資産総額（ - ）      | 654,721,691,196  |
| 発行済口数           | 242,296,010,466口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 2.7022           |
| （10,000口当たり）    | （27,022）         |

### 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7月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近５年間ににおける資本金の額の増減はありません。

##### （２）委託会社の機構

###### ・会社の意思決定機構

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

###### ・投資運用の意思決定機構

###### 投資環境見通しの策定

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

###### 運用戦略の決定

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

###### 運用計画の決定

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

###### ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部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。

###### 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。

###### 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。

###### ファンドに係る法人等の管理

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

###### 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 7月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

| 商品分類       | 本 数<br>( 本 ) | 純資産総額<br>( 百万円 ) |
|------------|--------------|------------------|
| 追加型株式投資信託  | 829          | 35,602,157       |
| 追加型公社債投資信託 | 16           | 1,535,876        |
| 単位型株式投資信託  | 94           | 419,510          |
| 単位型公社債投資信託 | 48           | 101,839          |
| 合 計        | 987          | 37,659,382       |

なお、純資産総額の金額については、百万円未満の端数を四捨五入して記載しておりますので、表中の個々の数字の合計と合計欄の数字とは一致しないことがあります。

## 3【委託会社等の経理状況】

< 更新後 >

### （１）財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱ＵＦＪ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。

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

### （２）監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第39期事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

### （１）【貸借対照表】

(単位：千円)

|        | 第38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024年3月31日現在) |
|--------|------------------------|------------------------|
| (資産の部) |                        |                        |
| 流動資産   |                        |                        |
| 現金及び預金 | 2 51,733,041           | 2 58,206,340           |

|            |   |             |   |             |
|------------|---|-------------|---|-------------|
| 有価証券       |   | 1,579,691   |   | 15,283      |
| 前払費用       |   | 770,747     |   | 679,199     |
| 未収入金       |   | 81,854      |   | 138,388     |
| 未収委託者報酬    |   | 16,753,855  |   | 21,064,747  |
| 未収収益       | 2 | 688,142     | 2 | 1,485,701   |
| 金銭の信託      |   | 10,400,000  |   | 10,500,500  |
| その他        |   | 745,576     |   | 371,400     |
| 流動資産合計     |   | 82,752,908  |   | 92,461,561  |
| 固定資産       |   |             |   |             |
| 有形固定資産     |   |             |   |             |
| 建物         | 1 | 181,551     | 1 | 2,936,036   |
| 器具備品       | 1 | 730,357     | 1 | 1,531,857   |
| 土地         |   | 628,433     |   | 628,433     |
| 建設仮勘定      |   | 1,111,177   |   | 45,140      |
| 有形固定資産合計   |   | 2,651,520   |   | 5,141,467   |
| 無形固定資産     |   |             |   |             |
| 電話加入権      |   | 15,822      |   | 15,822      |
| ソフトウェア     |   | 4,183,644   |   | 5,008,987   |
| ソフトウェア仮勘定  |   | 1,907,739   |   | 1,587,548   |
| 無形固定資産合計   |   | 6,107,206   |   | 6,612,357   |
| 投資その他の資産   |   |             |   |             |
| 投資有価証券     |   | 12,022,365  |   | 13,788,071  |
| 関係会社株式     |   | 159,536     |   | 159,536     |
| 投資不動産      | 1 | 807,066     | 1 | 1,788,120   |
| 長期差入保証金    |   | 689,492     |   | 689,867     |
| 前払年金費用     |   | 118,832     |   | 47,573      |
| 繰延税金資産     |   | 1,675,132   |   | 1,088,836   |
| 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 |   | 15,494,056  |   | 17,583,636  |
| 固定資産合計     |   | 24,252,782  |   | 29,337,461  |
| 資産合計       |   | 107,005,691 |   | 121,799,022 |

(単位：千円)

|         | 第38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024年3月31日現在) |
|---------|------------------------|------------------------|
| (負債の部)  |                        |                        |
| 流動負債    |                        |                        |
| 預り金     | 507,559                | 807,451                |
| 未払金     |                        |                        |
| 未払収益分配金 | 114,094                | 105,550                |
| 未払償還金   | 7,418                  | 43,553                 |
| 未払手数料   | 2 6,139,595            | 2 7,523,485            |
| その他未払金  | 2 955,697              | 2 885,002              |
| 未払費用    | 2 5,778,896            | 2 8,611,140            |
| 未払消費税等  | 439,657                | 623,219                |
| 未払法人税等  | 2,375,281              | 2,235,007              |
| 賞与引当金   | 849,840                | 1,182,242              |
| 役員賞与引当金 | 154,872                | 175,992                |
| その他     | 5,517                  | 12,303                 |

|           |            |            |
|-----------|------------|------------|
| 流動負債合計    | 17,328,431 | 22,204,949 |
| 固定負債      |            |            |
| 退職給付引当金   | 1,333,882  | 1,608,101  |
| 役員退職慰労引当金 | 75,667     | 30,105     |
| 時効後支払損引当金 | 254,296    | 250,350    |
| 資産除去債務    | -          | 1,428,586  |
| その他       | -          | 29,109     |
| 固定負債合計    | 1,663,846  | 3,346,253  |
| 負債合計      | 18,992,277 | 25,551,202 |
| (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   | 33,267,700 | 40,236,787 |
| 利益剰余金合計   | 40,608,289 | 47,577,377 |
| 株主資本合計    | 87,341,133 | 94,310,221 |

(単位：千円)

|              | 第38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024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 | 672,279                | 1,937,598              |
| 評価・換算差額等合計   | 672,279                | 1,937,598              |
| 純資産合計        | 88,013,413             | 96,247,820             |
| 負債純資産合計      | 107,005,691            | 121,799,022            |

## ( 2 ) 【損益計算書】

(単位：千円)

|         | 第38期<br>( 自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日 ) | 第39期<br>( 自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日 ) |
|---------|-----------------------------------------|-----------------------------------------|
| 営業収益    |                                         |                                         |
| 委託者報酬   | 84,121,445                              | 98,635,342                              |
| 投資顧問料   | 2,750,601                               | 3,117,320                               |
| その他営業収益 | 10,412                                  | 148,442                                 |
| 営業収益合計  | 86,882,459                              | 101,901,104                             |
| 営業費用    |                                         |                                         |
| 支払手数料   | 4 31,461,274                            | 4 34,494,219                            |
| 広告宣伝費   | 798,894                                 | 593,586                                 |

|           |            |            |
|-----------|------------|------------|
| 公告費       | 375        | 1,017      |
| 調査費       |            |            |
| 調査費       | 2,849,042  | 3,537,103  |
| 委託調査費     | 19,236,505 | 27,296,058 |
| 事務委託費     | 1,751,807  | 1,861,577  |
| 営業雑経費     |            |            |
| 通信費       | 113,480    | 137,737    |
| 印刷費       | 367,379    | 390,143    |
| 協会費       | 58,128     | 68,869     |
| 諸会費       | 18,447     | 20,108     |
| 事務機器関連費   | 2,238,382  | 2,531,009  |
| その他営業雑経費  | -          | 139,012    |
| 営業費用合計    | 58,893,717 | 71,070,444 |
| 一般管理費     |            |            |
| 給料        |            |            |
| 役員報酬      | 416,461    | 400,592    |
| 給料・手当     | 6,565,766  | 7,202,711  |
| 賞与引当金繰入   | 849,840    | 1,182,242  |
| 役員賞与引当金繰入 | 154,872    | 175,992    |
| 福利厚生費     | 1,279,885  | 1,424,215  |
| 交際費       | 8,942      | 10,054     |
| 旅費交通費     | 75,274     | 108,782    |
| 租税公課      | 403,955    | 397,138    |
| 不動産賃借料    | 719,707    | 728,550    |
| 退職給付費用    | 388,176    | 381,449    |
| 固定資産減価償却費 | 2,418,341  | 2,469,755  |
| 諸経費       | 444,313    | 490,104    |
| 一般管理費合計   | 13,725,534 | 14,971,590 |
| 営業利益      | 14,263,207 | 15,859,070 |

(単位：千円)

|             | 第38期<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|-------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業外収益       |                                       |                                       |
| 受取配当金       | 47,353                                | 54,618                                |
| 受取利息        | 4 10,279                              | 4 12,836                              |
| 投資有価証券償還益   | 609,102                               | 204,527                               |
| 収益分配金等時効完成分 | 94,351                                | 17,722                                |
| 受取賃貸料       | 4 65,808                              | 4 162,111                             |
| その他         | 36,894                                | 44,734                                |
| 営業外収益合計     | 863,788                               | 496,550                               |
| 営業外費用       |                                       |                                       |
| 投資有価証券償還損   | 32,995                                | 234,700                               |
| 時効後支払損引当金繰入 | 31,951                                | -                                     |
| 事務過誤費       | 2,680                                 | 10,822                                |
| 賃貸関連費用      | 14,262                                | 108,773                               |
| その他         | 32,394                                | 25,903                                |
| 営業外費用合計     | 114,284                               | 380,199                               |

|              |   |            |   |            |
|--------------|---|------------|---|------------|
| 経常利益         |   | 15,012,711 |   | 15,975,421 |
| 特別利益         |   |            |   |            |
| 投資有価証券売却益    |   | 387,113    |   | 464,927    |
| 固定資産売却益      |   | -          | 1 | 16,229     |
| 資産除去債務履行差額   |   | -          |   | 87,050     |
| 特別利益合計       |   | 387,113    |   | 568,207    |
| 特別損失         |   |            |   |            |
| 投資有価証券売却損    |   | 15,828     |   | 57,011     |
| 投資有価証券評価損    |   | 104,554    |   | 31,651     |
| 固定資産除却損      | 3 | 32,791     | 3 | 20,246     |
| 固定資産売却損      |   | -          | 2 | 65,427     |
| 減損損失         | 5 | 315,350    |   | -          |
| 企業結合関連費用     |   | -          | 6 | 1,187,136  |
| 特別損失合計       |   | 468,524    |   | 1,361,473  |
| 税引前当期純利益     |   | 14,931,300 |   | 15,182,154 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 4 | 4,860,444  | 4 | 4,542,085  |
| 法人税等調整額      |   | 271,471    |   | 102,468    |
| 法人税等合計       |   | 4,588,973  |   | 4,644,553  |
| 当期純利益        |   | 10,342,327 |   | 10,537,601 |

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

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<br>準備金 | その他<br>資本剰余金 | 資本<br>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<br>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<br>準備金 | その他利益剰余金    |            | 利益剰余金<br>合計 |            |
| 別途<br>積立金               |           | 繰越利益<br>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<br>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<br>有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>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<br>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 |

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：千円）

|                         | 株主資本      |           |              |             |
|-------------------------|-----------|-----------|--------------|-------------|
|                         | 資本金       | 資本剰余金     |              |             |
|                         |           | 資本<br>準備金 | その他<br>資本剰余金 | 資本<br>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                   |           |           |              |             |
| 企業結合による増加               |           |           |              |             |
| 剰余金の配当                  |           |           |              |             |
| 当期純利益                   |           |           |              |             |
| 株主資本以外の項目の<br>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<br>準備金 | その他利益剰余金    |            | 利益剰余金<br>合計 |            |
| 別途<br>積立金               |           | 繰越利益<br>剰余金 |            |             |            |
| 当期首残高                   | 342,589   | 6,998,000   | 33,267,700 | 40,608,289  | 87,341,133 |
| 当期変動額                   |           |             |            |             |            |
| 企業結合による増加               |           |             | 1,602,526  | 1,602,526   | 1,602,526  |
| 剰余金の配当                  |           |             | 5,171,039  | 5,171,039   | 5,171,039  |
| 当期純利益                   |           |             | 10,537,601 | 10,537,601  | 10,537,601 |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額(純額) |           |             |            |             |            |
| 当期変動額合計                 | —         | —           | 6,969,087  | 6,969,087   | 6,969,087  |
| 当期末残高                   | 342,589   | 6,998,000   | 40,236,787 | 47,577,377  | 94,310,221 |

|  |          |  |
|--|----------|--|
|  | 評価・換算差額等 |  |
|--|----------|--|

|                         | その他<br>有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>差額等合計 | 純資産合計      |
|-------------------------|----------------------|----------------|------------|
| 当期首残高                   | 672,279              | 672,279        | 88,013,413 |
| 当期変動額                   |                      |                |            |
| 企業結合による増加               |                      |                | 1,602,526  |
| 剰余金の配当                  |                      |                | 5,171,039  |
| 当期純利益                   |                      |                | 10,537,601 |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額（純額） | 1,265,319            | 1,265,319      | 1,265,319  |
| 当期変動額合計                 | 1,265,319            | 1,265,319      | 8,234,406  |
| 当期末残高                   | 1,937,598            | 1,937,598      | 96,247,820 |

## [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 | 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. 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。

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。

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。

（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38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024年3月31日現在) |
|-------|------------------------|------------------------|
| 建物    | 1,006,606千円            | 498,805千円              |
| 器具備品  | 1,985,072千円            | 1,643,689千円            |
| 投資不動産 | 163,978千円              | 211,090千円              |

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38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024年3月31日現在) |
|--------|------------------------|------------------------|
| 預金     | 40,165,058千円           | 39,776,992千円           |
| 未収収益   | 15,046千円               | 12,312千円               |
| 未払手数料  | 790,279千円              | 886,173千円              |
| その他未払金 | 77,007千円               | 105,407千円              |
| 未払費用   | 277,358千円              | 599,493千円              |

（損益計算書関係）

1.固定資産売却益の内訳

|      | 第38期<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 器具備品 | -                                     | 16,229千円                              |
| 計    | -                                     | 16,229千円                              |

## 2. 固定資産売却損の内訳

|      | 第38期<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 器具備品 | -                                     | 65,427千円                              |
| 計    | -                                     | 65,427千円                              |

## 3. 固定資産除却損の内訳

|        | 第38期<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|--------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 建物     | 1,047千円                               | 15,825千円                              |
| 器具備品   | 29,762千円                              | 3,986千円                               |
| ソフトウェア | 1,981千円                               | 434千円                                 |
| 計      | 32,791千円                              | 20,246千円                              |

## 4. 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38期<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|--------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 支払手数料        | 4,893,312千円                           | 5,006,309千円                           |
| 受取利息         | 10,236千円                              | 12,747千円                              |
| 受取賃貸料        | 68,168千円                              | 152,876千円                             |
| 法人税、住民税及び事業税 | 3,947,200千円                           | 132,303千円                             |

## 5. 減損損失

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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。

ホームページのリニューアルに伴い、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。

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

当事業年度については、該当事項はありません。

## 6. 企業結合関連費用

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

前事業年度については、該当事項はありません。

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

企業結合に伴うものであり、主にシステム統合費用などであります。

（株主資本等変動計算書関係）

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<br>株式数（株） | 当事業年度増加<br>株式数（株） | 当事業年度減少<br>株式数（株） | 当事業年度末<br>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。

|          |             |
|----------|-------------|
| 配当金の総額   | 6,075,125千円 |
| 1株当たり配当額 | 28,713円     |
| 基準日      | 2022年3月31日  |
| 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において、次のとおり決議しております。

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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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<br>株式数（株） | 当事業年度増加<br>株式数（株） | 当事業年度減少<br>株式数（株） | 当事業年度末<br>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

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。

|          |             |
|----------|-------------|
| 配当金の総額   | 5,171,039千円 |
| 1株当たり配当額 | 24,440円     |
| 基準日      | 2023年3月31日  |
| 効力発生日    | 2023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

2024年6月26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。

|          |              |
|----------|--------------|
| 配当金の総額   | 45,747,620千円 |
| 配当の原資    | 利益剰余金        |
| 1株当たり配当額 | 216,218円     |
| 基準日      | 2024年3月31日   |
| 効力発生日    | 2024年6月27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38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024年3月31日現在) |
|-----|------------------------|------------------------|
| 1年内 | 962,809千円              | 681,212千円              |

|     |             |             |
|-----|-------------|-------------|
| 1年超 | 1,532,728千円 | 851,515千円   |
| 合計  | 2,495,537千円 | 1,532,728千円 |

## （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38期(2023年3月31日現在)

|            | 貸借対照表<br>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（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38期(2023年3月31日現在)

（単位：千円）

|                   | 1年以内       | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>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    | -    |

## 第39期(2024年3月31日現在)

|            | 貸借対照表<br>計上額（千円） | 時価（千円）     | 差額（千円） |
|------------|------------------|------------|--------|
| (1) 有価証券   | 15,283           | 15,283     | -      |
| (2) 金銭の信託  | 10,500,500       | 10,500,500 | -      |
| (3) 投資有価証券 | 13,788,071       | 13,788,071 | -      |
| 資産計        | 24,303,855       | 24,303,855 | -      |

(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39期(2024年3月31日現在)

（単位：千円）

|                   | 1年以内       | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超   |
|-------------------|------------|-------------|--------------|--------|
| 現金及び預金            | 58,206,340 | -           | -            | -      |
| 金銭の信託             | 10,500,500 | -           | -            | -      |
| 未収委託者報酬           | 21,064,747 | -           | -            | -      |
| 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              | 15,283     | 5,351,373   | 347,505      | 11,696 |
| 合計                | 89,786,871 | 5,351,373   | 347,505      | 11,696 |

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。

第39期(2024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   | -         | 15,283     | - | 15,283     |
| 金銭の信託  | -         | 10,500,500 | - | 10,500,500 |
| 投資有価証券 | 2,014,968 | 11,773,103 | - | 13,788,071 |
| 資産計    | 2,014,968 | 22,288,887 | - | 24,303,855 |

（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38期（2023年3月31日現在）及び第39期（2024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38期(2023年3月31日現在)

|                          | 種類  | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額(千円)    |
|--------------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額が<br>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<br>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。

第39期(2024年3月31日現在)

|                          | 種類  | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額(千円)    |
|--------------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えるもの  | 株式  | -                | -            | -         |
|                          | 債券  | -                | -            | -         |
|                          | その他 | 17,364,277       | 14,269,984   | 3,094,293 |
|                          | 小計  | 17,364,277       | 14,269,984   | 3,094,293 |
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えないもの | 株式  | -                | -            | -         |
|                          | 債券  | -                | -            | -         |
|                          | その他 | 6,939,577        | 7,241,136    | 301,559   |
|                          | 小計  | 6,939,577        | 7,241,136    | 301,559   |
| 合計                       |     | 24,303,855       | 21,511,121   | 2,792,733 |

（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10,500,500千円、取得原価は10,500,000千円）を含めております。

#### 3. 売却したその他有価証券

## 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      |

## 第39期（自 2023年4月1日 至 2024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 | 3,750,272 | 464,927     | 57,011      |
| 合計  | 3,750,272 | 464,927     | 57,011      |

## 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。

当事業年度において、有価証券について31,651千円（その他有価証券のその他31,651千円）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38期<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|--------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 退職給付債務の期首残高  | 3,723,521 千円                          | 3,582,778 千円                          |
| 勤務費用         | 196,190                               | 182,947                               |
| 利息費用         | 25,925                                | 39,626                                |
| 数理計算上の差異の発生額 | 186,130                               | 79,379                                |
| 退職給付の支払額     | 176,727                               | 300,286                               |
| 過去勤務費用の発生額   | -                                     | -                                     |
| 企業結合による影響額   | -                                     | 226,499                               |
| 退職給付債務の期末残高  | 3,582,778                             | 3,652,185                             |

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

|              | 第38期<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|--------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 年金資産の期首残高    | 2,583,927 千円                          | 2,425,752 千円                          |
| 期待運用収益       | 46,453                                | 43,626                                |
| 数理計算上の差異の発生額 | 103,934                               | 227,699                               |
| 事業主からの拠出額    | -                                     | -                                     |
| 退職給付の支払額     | 100,694                               | 204,536                               |
| 年金資産の期末残高    | 2,425,752                             | 2,492,542                             |

## (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38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024年3月31日現在) |
|---------------------|------------------------|------------------------|
| 積立型制度の<br>退職給付債務    | 2,468,195 千円           | 2,250,427 千円           |
| 年金資産                | 2,425,752              | 2,492,542              |
|                     | 42,442                 | 242,114                |
| 非積立型制度の退職給付債務       | 1,114,583              | 1,401,758              |
| 未積立退職給付債務           | 1,157,025              | 1,159,643              |
| 未認識数理計算上の差異         | 281,343                | 558,841                |
| 未認識過去勤務費用           | 223,319                | 157,957                |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 1,215,049              | 1,560,527              |
| 退職給付引当金             | 1,333,882              | 1,608,101              |
| 前払年金費用              | 118,832                | 47,573                 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 1,215,049              | 1,560,527              |

## (4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

|                     | 第38期<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|---------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 勤務費用                | 196,190 千円                            | 182,947 千円                            |
| 利息費用                | 25,925                                | 39,626                                |
| 期待運用収益              | 46,453                                | 43,626                                |
| 数理計算上の差異の<br>費用処理額  | 6,532                                 | 29,581                                |
| 過去勤務費用の費用処理額        | 65,361                                | 65,361                                |
| 退職給付制度の統合に係る<br>調整額 | -                                     | 34,505                                |
| その他                 | 1,600                                 | 2,196                                 |
| 確定給付制度に係る<br>退職給付費用 | 236,091                               | 251,429                               |

(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。「退職給付制度の統合に係る調整額」は企業結合関連費用の一部として特別損失に計上しております。

## (5)年金資産に関する事項

## 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38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024年3月31日現在) |
|-----|------------------------|------------------------|
| 債券  | 63.6 %                 | 62.0 %                 |
| 株式  | 34.2                   | 35.9                   |
| その他 | 2.2                    | 2.1                    |
| 合計  | 100                    | 100                    |

## 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38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024年3月31日現在) |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 割引率       | 0.066～1.13%            | 1.39～1.41%             |
| 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152,084千円、当事業年度164,524千円であります。

## (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38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024年3月31日現在) |
|---------------|------------------------|------------------------|
| 繰延税金資産        |                        |                        |
| 減損損失          | 499,742千円              | 389,750千円              |
| 投資有価証券評価損     | 47,876                 | 30,021                 |
| 未払事業税         | 169,997                | 126,161                |
| 賞与引当金         | 260,221                | 362,002                |
| 役員賞与引当金       | 29,828                 | 33,564                 |
| 役員退職慰労引当金     | 23,169                 | 9,218                  |
| 退職給付引当金       | 408,434                | 492,400                |
| 減価償却超過額       | 227,100                | 199,986                |
| 差入保証金         | 52,869                 | -                      |
| 資産除去債務        | -                      | 16,900                 |
| 時効後支払損引当金     | 77,865                 | 76,657                 |
| その他           | 212,315                | 227,182                |
| 繰延税金資産 小計     | 2,009,420              | 1,963,847              |
| 評価性引当額        | -                      | -                      |
| 繰延税金資産 合計     | 2,009,420              | 1,963,847              |
| 繰延税金負債        |                        |                        |
| 前払年金費用        | 36,386                 | 14,567                 |
| その他の有価証券評価差額金 | 296,702                | 855,135                |
| その他           | 1,199                  | 5,308                  |
| 繰延税金負債 合計     | 334,288                | 875,010                |
| 繰延税金資産の純額     | 1,675,132              | 1,088,836              |

## 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38期（2023年3月31日現在）及び第39期（2024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、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。

## (企業結合等関係)

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) 企業結合を行った主な理由

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. 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いたしました。

### （資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

#### 1. 当該資産除去債務の概要

建物の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

#### 2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を取得から15年と見積り、割引率は1.1%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

#### 3. 当該資産除去債務の総額の増減

|                | 第38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024年3月31日現在) |
|----------------|------------------------|------------------------|
| 期首残高           | -                      | -                      |
| 有形固定資産の取得に伴う増加 | -                      | 1,420,750千円            |
| 時の経過による調整額     | -                      | 7,835千円                |
| 期末残高           | -                      | 1,428,586千円            |

### （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38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）及び第39期（自 2023年4月1日 至 2024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38期（自2022年4月1日 至 2023年3月31日）及び第39期（自 2023年4月1日 至 2024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<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係                                 | 取引の内容                         | 取引金額<br>(注5)    | 科目     | 期末残高<br>(注5)  |
|-----|----------------------------|-----------------|------------------|-------------|------------------------|-----------------------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------|---------------|
| 親会社 | ㈱三菱UFJ<br>フィナンシャル・<br>グループ | 東京都<br>千代田<br>区 | 2,141,513<br>百万円 | 銀行持株<br>会社業 | 被所有<br>間接<br>100.0%    | 連結納税等                                         | 連結納税等に<br>伴う支払<br>(注1)        | 3,947,200<br>千円 | その他未払金 | 77,007<br>千円  |
| 親会社 | 三菱UFJ<br>信託銀行㈱             | 東京都<br>千代田<br>区 | 324,279<br>百万円   | 信託業、<br>銀行業 | 被所有<br>直接<br>100.0%    | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に係る事務代<br>行手数料の支払<br>(注2) | 4,893,312<br>千円 | 未払手数料  | 790,279<br>千円 |
|     |                            |                 |                  |             |                        | 投資の助言<br><br>役員の兼任                            | 投資助言料<br>(注3)                 | 463,416<br>千円   | 未払費用   | 253,093<br>千円 |

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係 | 取引の内容                             | 取引金額<br>(注5)  | 科目     | 期末残高<br>(注5)  |
|-----|----------------------------|-----------------|------------------|-------------|------------------------|---------------|-----------------------------------|---------------|--------|---------------|
| 親会社 | ㈱三菱UFJ<br>フィナンシャル・<br>グループ | 東京都<br>千代田<br>区 | 2,141,513<br>百万円 | 銀行持株<br>会社業 | 被所有<br>間接<br>100.0%    | グループ通算制<br>度  | グループ通算<br>制度に伴う通<br>算税効果額<br>(注4) | 132,303<br>千円 | その他未払金 | 105,407<br>千円 |

|     |                  |                 |                |             |                     |                                               |                                       |                 |       |               |
|-----|------------------|-----------------|----------------|-------------|---------------------|-----------------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|---------------|
| 親会社 | 三菱UFJ<br>信託銀行(株) | 東京都<br>千代田<br>区 | 324,279<br>百万円 | 信託業、<br>銀行業 | 被所有<br>直接<br>100.0% | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料の<br>支払<br>(注2) | 5,006,309<br>千円 | 未払手数料 | 886,173<br>千円 |
|     |                  |                 |                |             |                     | 投資の助言<br><br>役員の兼任                            | 投資助言料<br>(注3)                         | 463,831<br>千円   | 未払費用  | 260,800<br>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。
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. グループ通算制度に基づく通算税効果額であります。
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38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

| 種類          | 会社等の<br>名称                       | 所在地             | 資本金              | 事業の<br>内容 | 議決権等<br>の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係                                 | 取引の内容                                 | 取引金額<br>(注2)    | 科目    | 期末残高<br>(注2)    |
|-------------|----------------------------------|-----------------|------------------|-----------|----------------------------|-----------------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|-----------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | (株)三菱UFJ<br>銀行                   | 東京都<br>千代田<br>区 | 1,711,958<br>百万円 | 銀行業       | なし                         | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料<br>の支払<br>(注1) | 4,052,979<br>千円 | 未払手数料 | 868,785<br>千円   |
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJ<br>モルガン・<br>スタンレー<br>証券(株) | 東京都<br>千代田<br>区 | 40,500<br>百万円    | 証券業       | なし                         | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料<br>の支払<br>(注1) | 6,661,991<br>千円 | 未払手数料 | 1,218,051<br>千円 |

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

| 種類          | 会社等の<br>名称     | 所在地             | 資本金              | 事業の<br>内容 | 議決権等<br>の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係                                 | 取引の内容                                 | 取引金額<br>(注2)    | 科目    | 期末残高<br>(注2)    |
|-------------|----------------|-----------------|------------------|-----------|----------------------------|-----------------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|-----------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | (株)三菱UFJ<br>銀行 | 東京都<br>千代田<br>区 | 1,711,958<br>百万円 | 銀行業       | なし                         | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料<br>の支払<br>(注1) | 4,354,007<br>千円 | 未払手数料 | 1,028,586<br>千円 |

|             |                                |                 |               |     |    |                                               |                                       |                 |       |                 |
|-------------|--------------------------------|-----------------|---------------|-----|----|-----------------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|-----------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJ<br>モルガン・<br>スタンレー<br>証券㈱ | 東京都<br>千代田<br>区 | 40,500<br>百万円 | 証券業 | なし | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料<br>の支払<br>(注1) | 7,493,449<br>千円 | 未払手数料 | 1,449,414<br>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38期<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|--------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 1株当たり純資産額    | 415,979.76円                           | 454,898.22円                           |
| 1株当たり当期純利益金額 | 48,881.17円                            | 49,804.10円                            |

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。
2. 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38期<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|--------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 当期純利益金額（千円）        | 10,342,327                            | 10,537,601                            |
| 普通株主に帰属しない金額（千円）   | -                                     | -                                     |
| 普通株式に係る当期純利益金額（千円） | 10,342,327                            | 10,537,601                            |
| 普通株式の期中平均株式数（株）    | 211,581                               | 211,581                               |

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<更新後>

## （１）受託会社

名称：三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

（再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）

資本金の額：324,279百万円（2024年3月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

## （２）販売会社

| 名称 | 資本金の額<br>(2024年3月末現在) | 事業の内容 |
|----|-----------------------|-------|
|----|-----------------------|-------|

|                |             |                               |
|----------------|-------------|-------------------------------|
| 三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社  | 324,279 百万円 | 銀行業務および信託業務を営んでいます。           |
| a u 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。 |
| フィデリティ証券株式会社   | 12,657 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>

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。

#### <訂正後>

該当ありません。（2024年7月末現在）

（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9月25日

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤  
業務執行社員**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）の2024年1月18日から2024年7月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）の2024年7月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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

2024年6月7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

## 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アセットマネジメント株式会社の2024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。