

【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11月22日提出
【発行者名】	三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 横川 直
【本店の所在の場所】	東京都港区東新橋一丁目９番１号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【電話番号】	03-4223-3037
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン（為替ヘッジ あり）予想分配金提示型 モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン（為替ヘッジ なし）予想分配金提示型
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン（為替ヘッジ あり）予想分配金提示型 １兆円を上限とします。 モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン（為替ヘッジ なし）予想分配金提示型 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5月24日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について有価証券報告書の提出に伴う関係情報の更新等を行うため、本訂正届出書を提出します。

2【訂正の内容】

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

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

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

当ファンドは、主として中長期的な値上がり益の獲得をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、各ファンドについて、5,000億円です。

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

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

商品分類表

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

属性区分表

モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン（為替ヘッジあり）予想分配金提示型

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス	特殊型
株式	年１回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり (フルヘッジ)	日経２２５	ブル・ベア型
一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ()	年２回 年４回 年６回 (隔月) 年１２回 (毎月) 日々 その他 ()	日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX その他 ()	条件付運用型 ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型 その他 ()
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (株式一般))						

資産複合 ()						
-------------	--	--	--	--	--	--

モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン（為替ヘッジなし）予想分配金提示型

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス	特殊型
株式	年 1 回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり ()	日経 2 2 5	ブル・ベア型
一般 大型株 中小型株 債券	年 2 回 年 4 回 年 6 回 (隔月)	日本 北米 欧州	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	T O P I X	条件付運用型
一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ()	年12回 (毎月)	アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージン グ			その他 ()	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型
日々 その他 ()						その他 ()
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))						
資産複合 ()						

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

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

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

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	ＭＭＦ（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「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

投資対象資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（ＢＢＢ格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（ＢＢ格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信		信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。

決算頻度	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。
	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。
投資対象地域	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	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。
投資形態	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	ファミリーファンド	信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	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。
	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。
対象インデックス	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。
	日経 2 2 5	信託約款において、日経 2 2 5 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

信託財産の成長を目指して運用を行います。

ファンドの特色

特色

1

世界各国の株式のうち、プレミアム企業の株式に投資を行い、中長期的な値上がり益の獲得を目指します。

プレミアム企業とは

当ファンドにおいて「プレミアム企業」とは、高いブランド力、有力な特許、強固な販売網など、競争優位の無形資産を裏付けに、持続的にフリー・キャッシュフローを増大させることが期待される企業を指します。



* 競争優位の無形資産は、競合他社と自社の製品・サービスを差別化することに寄与するため、収益力の源泉となり、また、競合他社による模倣や複製が困難であるため、収益力を持続させる役割を担います。

※上図はプレミアム企業のイメージをあらわしたものです。

フリー・キャッシュフローに着目すると

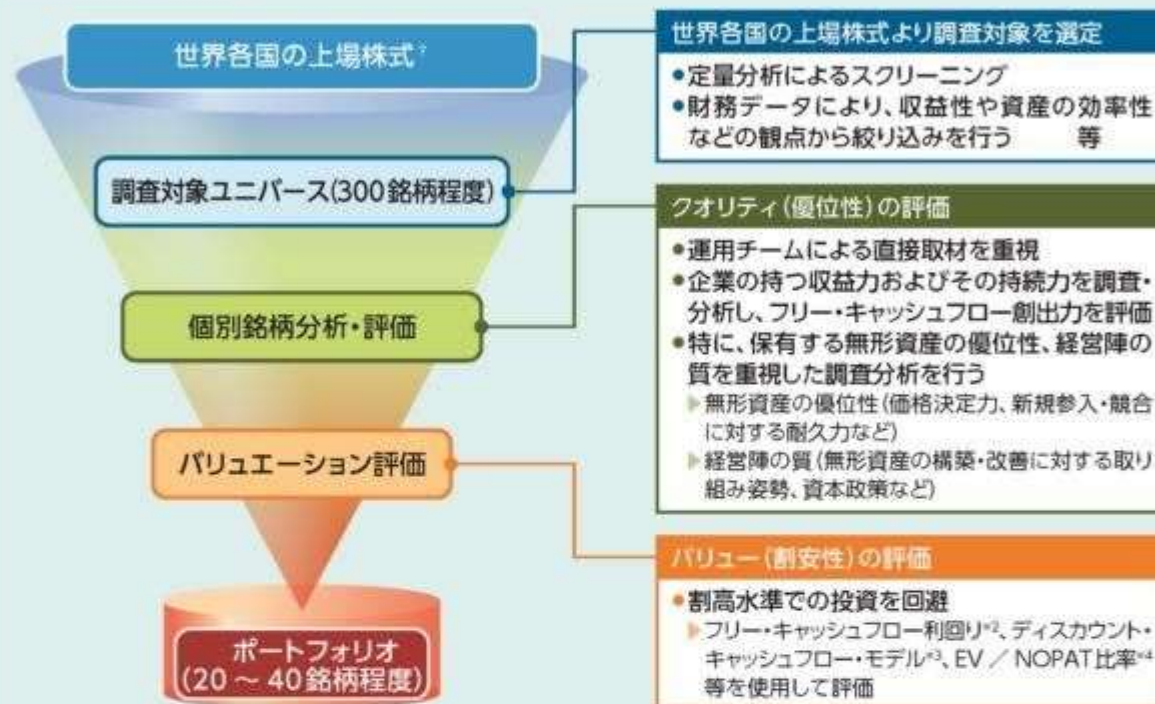
- ◆フリー・キャッシュフローとは、「事業活動による儲け」から「必要な投資」を差し引いて、手元の現金がいくら増えたかを表す指標です。営業キャッシュフロー（事業活動により得られた現金収入とそれに要する現金支出との差額）と投資キャッシュフロー（事業を維持・拡大するために必要な投資活動による現金収支）を合算して求めます。
- ◆フリー・キャッシュフローは、配当や自社株買いなどの「株主還元」や「事業への再投資」の原資となることから、企業価値を中長期的に維持・向上できるかを判断するのに役立ちます。

特色2

銘柄の選定に際しては、長期保有を視野に徹底的なボトムアップ・アプローチ^{*1}を行い、利益成長の持続可能性を多面的に分析します。

- ◆ 収益性、財務内容の分析に加え、保有する無形資産や経営陣の質などから利益成長の持続可能性を多面的に分析します。

運用プロセス



[†] 金融商品取引所上場(これに準ずるものを含みます。)株式をいいます。

※ 上記は2024年8月末現在のものであり、将来変更される可能性があります。また、一部簡略化して記載している部分があります。

- ◆ 原則として、厳選した20～40銘柄に集中投資を行います。
- ◆ 株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。



- *1 【ボトムアップ・アプローチ】 投資対象となる個別企業の調査、分析に裏付けられた投資判断をもとに銘柄選定を行い、その積み上げによりポートフォリオを構築していく方法です。
- *2 【フリー・キャッシュフロー利回り】 1株当たりフリー・キャッシュフロー / 株価
- *3 【ディスカウント・キャッシュフロー・モデル】 将来にわたって生み出すフリー・キャッシュフローを現在価値に割り引いて企業価値を評価する手法を用いたモデルのことです。
- *4 【EV / NOPAT比率】 EV(企業価値)がNOPAT(税引後営業利益)の何倍かを表す指標です。
 (EV(企業価値)は「Enterprise Value」の略称で、株式時価総額+ネット有利子負債(有利子負債から現預金等のすぐにはキャッシュ化可能な資産を差し引いた金額)で定義されます。)

特色3

モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・リミテッドに運用指図の権限を委託します。

- ◆ モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・リミテッド(所在地:英国ロンドン)は、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメントの欧州拠点です。
- ◆ モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメントは、世界各国に拠点を持つグローバル総合金融機関であるモルガン・スタンレーの資産運用部門で、株式運用において大手の資産運用グループの一つです。

特色4

為替ヘッジの有無により、「為替ヘッジあり」および「為替ヘッジなし」があります。

- ◆「為替ヘッジあり」は、外貨建資産について、原則として対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をはかります。為替ヘッジに関しては、委託会社が行います。

※一部の通貨については、その通貨との相関が高いと判断される代替通貨により対円で為替ヘッジを行うことがあります。

- ◆「為替ヘッジなし」は、外貨建資産について、原則として為替ヘッジを行いません。

特色5

毎月の決算日（毎月23日（休業日の場合は翌営業日））の前営業日の基準価額に応じた分配をめざします。

- ◆分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- ◆原則として、決算日の前営業日の基準価額に応じ、以下の金額の分配をめざします。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があります。また、決算日にかけて基準価額が急激に変動し、以下に記載された分配金額が分配対象額を超える場合等には、当該分配金額としないことや分配を行わないことがあります。

決算日の前営業日の基準価額	分配金額(1万口当たり、税引前)
10,500円未満	基準価額の水準等を勘案して決定
10,500円以上11,000円未満	50円
11,000円以上12,000円未満	100円
12,000円以上13,000円未満	150円
13,000円以上14,000円未満	200円
14,000円以上15,000円未満	250円
15,000円以上	300円

※基準価額が上記の一定の水準に一度でも到達すればその水準に応じた分配を続ける、というものではありません。

※分配により基準価額は下落します。そのため、基準価額に影響を与え、次期以降の分配金額は変動する場合があります。

また、あらかじめ一定の分配金額を保証するものではありません。

※基準価額の値上がりにより、分配金の支払い準備のために用意していた資金を超える分配金テーブルに該当することによって資金が不足する場合等は、テーブル通りの分配ができないことがあります。

※上記表に記載された基準価額および分配金額は、予想に基づくものであり、将来の運用の成果を保証または示唆するものではありません。

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。

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。



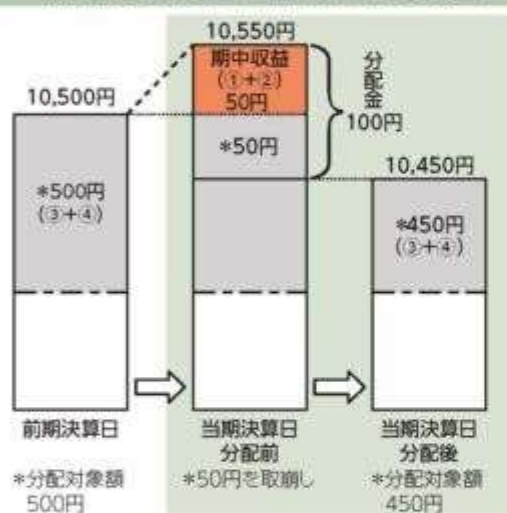
- ◆分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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。

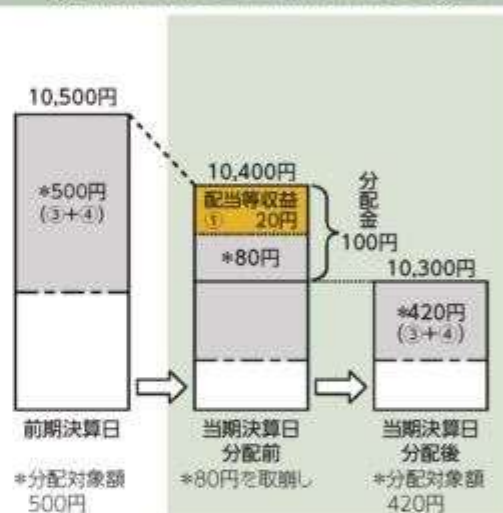
分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

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



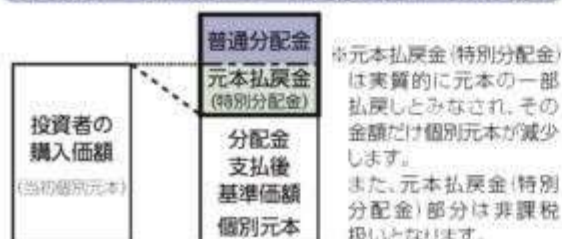
※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

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。

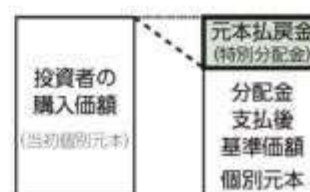
収益調整金: 追加型投資信託で追加設定が行われることによって、既存の受益者への収益分配可能額が薄まらないようにするために設けられた勘定です。

- ◆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率が小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



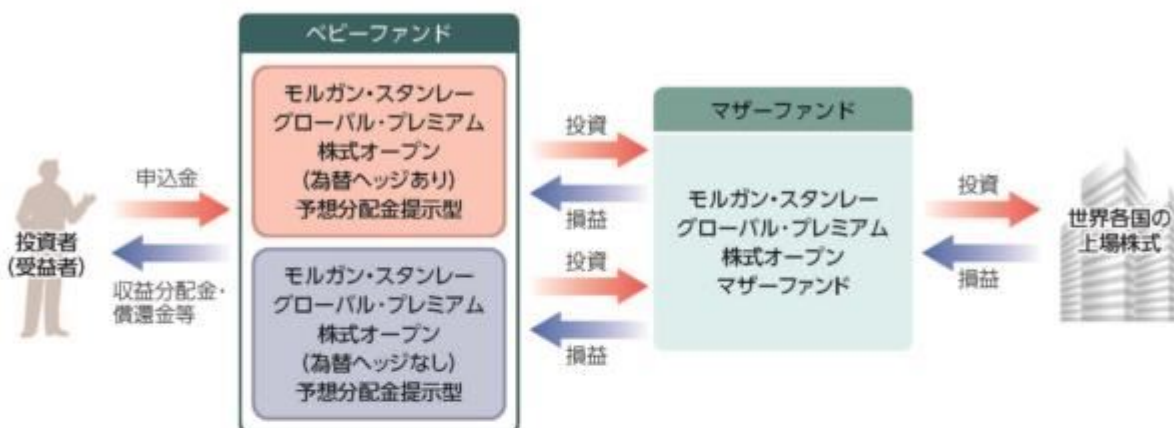
普通分配金: 個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

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

■ ファンドのしくみ

ファミリーファンド方式により運用を行います。

ファミリーファンド方式とは、受益者から投資された資金をまとめた投資信託をベビーファンドとし、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資して、マザーファンドにおいて実質的な運用を行う仕組みです。



*各ファンドおよび「モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン(為替ヘッジあり)」「モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン(為替ヘッジなし)」「モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン<隔月決算型>(為替ヘッジあり) 予想分配金提示型」「モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン<隔月決算型>(為替ヘッジなし) 予想分配金提示型」の間でのスイッチングが可能です。

※販売会社によっては、一部のファンドのみの取扱いとなる場合やスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

スイッチングを行う場合の購入時手数料は、販売会社が定めています。

また、スイッチングにより換金をする場合は、換金代金の利益に対して税金がかかります。

くわしくは販売会社にご確認ください。

■ 主な投資制限

マザーファンドへの投資	マザーファンドへの投資割合は、制限を設けません。
株式への投資	株式への実質投資割合は、制限を設けません。
同一銘柄の株式への投資	同一銘柄の株式への実質投資割合は、各ファンドの純資産総額の10%以内とします。
外貨建資産への投資	外貨建資産への実質投資割合は、制限を設けません。

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 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。

委託会社と再委託先との契約 「信託財産の運用指図権限委託契約」	運用指図権限委託の内容およびこれに係る事務の内容、再委託先が受ける報酬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变更
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投信株式会社に变更
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变更
2023年10月 エム・ユー投資顧問株式会社の有価証券運用事業を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社へ統合し、商号を三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社に变更
- ・大株主の状況

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

< 訂正後 >

委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。
委託会社と再委託先との契約 「信託財産の運用指図権限委託契約」	運用指図権限委託の内容およびこれに係る事務の内容、再委託先が受ける報酬等が定められています。

委託会社の概況（2024年8月末現在）

- ・金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・設立年月日
1985年8月1日
- ・資本金
2,000百万円
- ・沿革
1997年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始

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

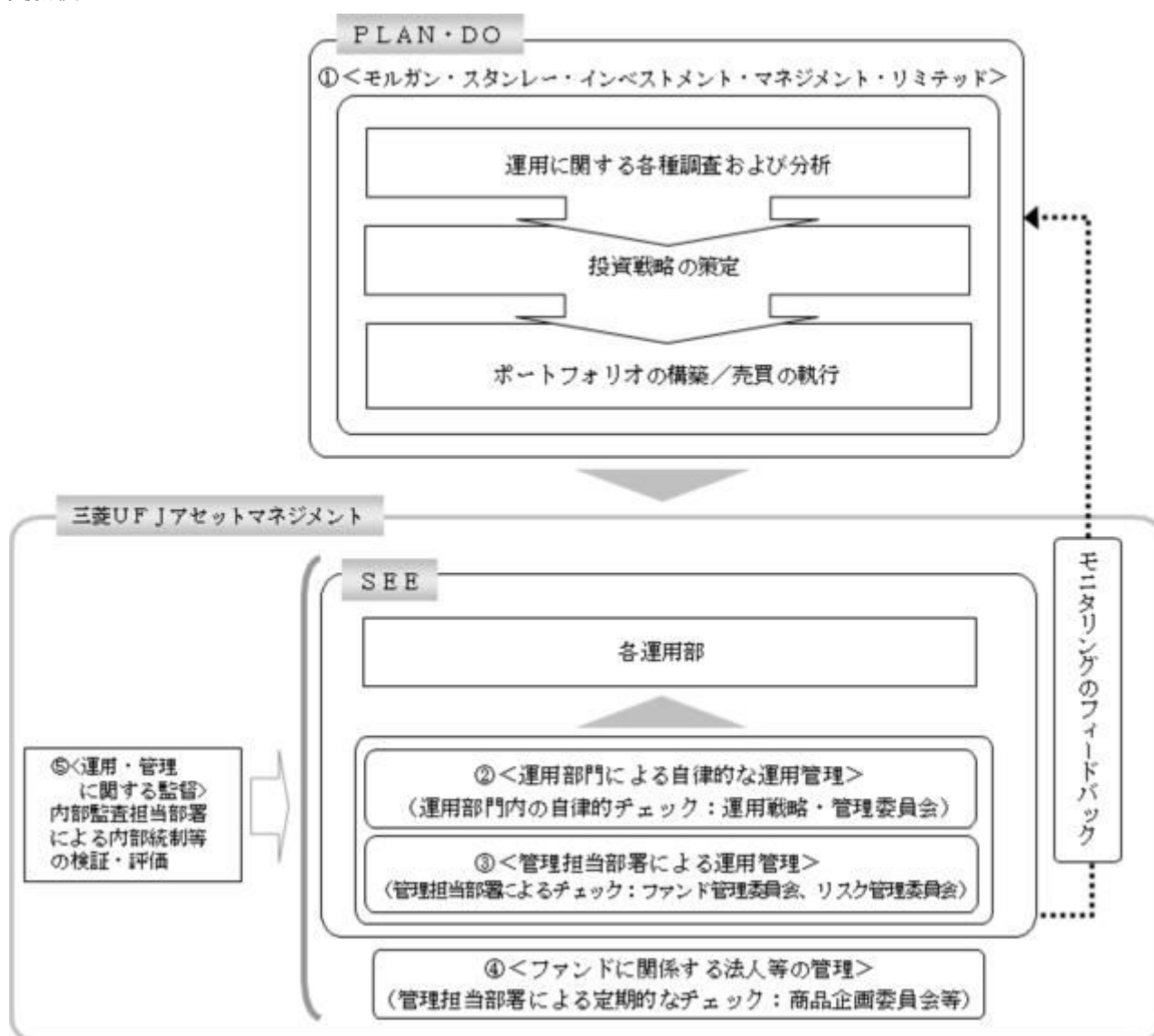
・大株主の状況

株主名	住所	所有株式数	所有比率
株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	211,581株	100.0%

2【投資方針】

(3)【運用体制】

<更新後>



運用の指図に関する権限の委託

当ファンドは、マザーファンドの運用の指図に関する権限を、モルガン・スタンレー・インベ

ストメント・マネジメント・リミテッド（「再委託先」といいます。）に委託しています。再委託先は与えられた運用の指図に関する権限の範囲内で投資戦略を策定し、ポートフォリオの構築を行います。

運用部門による自律的な運用管理

委託会社では、運用部の担当ファンドマネジャーが日々再委託先の運用の適切性を確認しているほか、運用部門としても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

委託会社では、運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）が、（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。その内容は更に運用部門から再委託先に還元されます。

ファンドに係る法人等の管理

再委託先、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.mufig.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。

（主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。）

**株価変動
リスク**

株式の価格は、国内および国際的な政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給関係等の影響を受け変動します。株式の価格が変動すれば当ファンドの基準価額の変動要因となります。

**為替変動
リスク****<為替ヘッジあり>**

投資する株式は、世界各国の現地通貨建等のものとなります。外貨建資産に投資を行いますので、為替変動リスクが生じます。これらの外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をはかりますが、設定や解約等の資金動向、為替ヘッジのタイミングおよび範囲、ならびに市況動向等の要因により、完全に為替変動リスクを排除することはできません。また、円金利がヘッジ対象となる外貨建資産の通貨の金利より低い場合、円とヘッジ対象となる外貨建資産の通貨との金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。

<為替ヘッジなし>

投資する株式は、世界各国の現地通貨建等のものとなります。外貨建資産に投資を行いますので、投資している有価証券の発行通貨が円に対して強く（円安に）なれば当ファンドの基準価額の上昇要因となり、弱く（円高に）なれば当ファンドの基準価額の下落要因となります。

・信用リスク

株式の発行企業の経営、財務状況が悪化したり、市場においてその懸念が高まった場合には、株式の価格が下落すること、配当金が減額あるいは支払いが停止されること、倒産等によりその価値がなくなること等があります。

・流動性リスク

有価証券等を売買しようとする際に、その有価証券等の取引量が十分でない場合や規制等により取引が制限されている場合には、売買が成立しなかったり、十分な数量の売買が出来なかったり、ファンドの売買自体によって市場価格が動き、結果として不利な価格での取引となる場合があります。

留意事項

- ・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。
- ・ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- ・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、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、ファンドの基準価額に影響する場合があります。

（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。

〔再委託先の管理体制〕

リスク管理およびコンプライアンスの機能は、運用部門から独立したコンプライアンスおよびリスク・モニタリング部門によって実施しております。同部門により、投資ガイドライン違反やリスク管理指標からの逸脱がないかどうかのチェックを行なっています。

また、このほかに、投資ガイドラインなどに関するチェックの機能としては、コンプライアンス・スクリーニング・システム等により売買執行前および執行後のモニタリングを行いチェックします。

〔委託会社における再委託先に対する確認体制〕

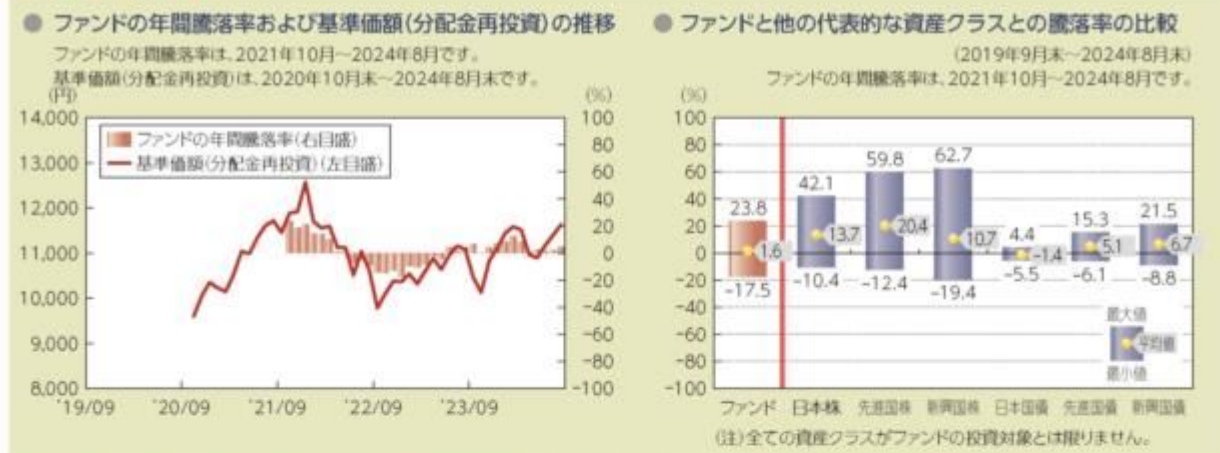
委託会社と再委託先の間で、再委託先がファンド運用コンセプトを維持し、適切に投資リスク管理が図られるよう運用指図権限委託契約として委託内容を定めています。また、委託会社は再委託先に対し定期的に書面による調査等を実施し、投資リスクに対する管理体制の確認を行っています。

また、再委託先からの定期的なデ・タ還元を受け、ファンドのリスクの運営状況の確認を行っているほか、委託会社自身でもモニタリングし、投資リスクを管理しています。

■ 代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

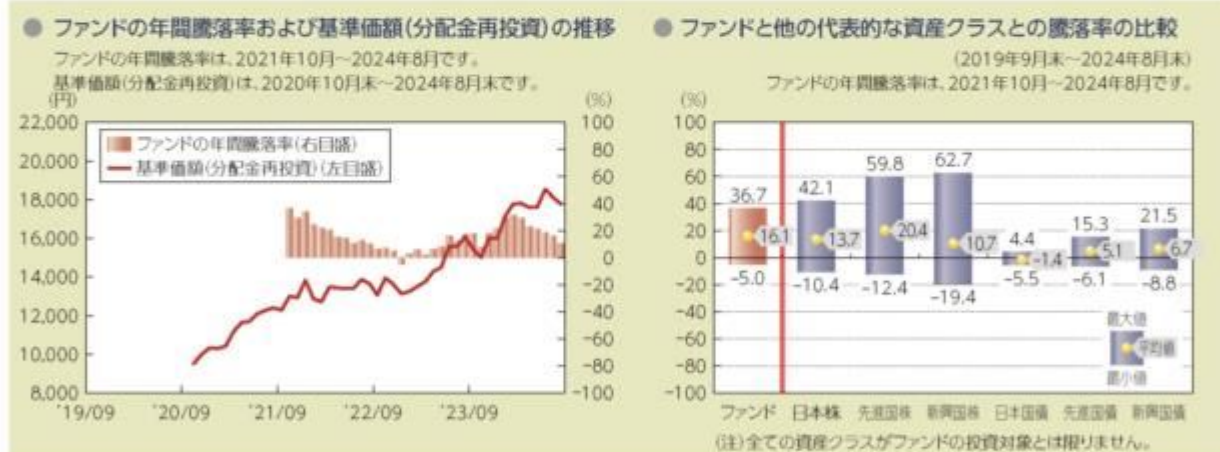
為替ヘッジあり

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



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

為替ヘッジなし



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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

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

<更新後>

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8月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

（参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間（以下「当期間」といいます。）（2024年2月27日～2024年8月23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
為替ヘッジあり	2.05%	1.98%	0.07%
為替ヘッジなし	2.00%	1.98%	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】

【モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン（為替ヘッジあり）予想分配金提示型】

（１）【投資状況】

2024年 8月30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	4,460,720,660	97.26
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	125,456,228	2.74
純資産総額		4,586,176,888	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 8月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン マザーファンド	627,289,823	7.0871	4,445,665,705	7.1111	4,460,720,660	97.26

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年 8月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	97.26
合計	97.26

（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8月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

		純資産総額		基準価額 （1万口当たりの純資産価額）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間末日	（2020年11月24日）	1,332,831,006	1,332,831,006	9,999	9,999
第2計算期間末日	（2020年12月23日）	1,894,830,030	1,896,684,418	10,218	10,228
第3計算期間末日	（2021年 1月25日）	2,113,036,904	2,115,114,393	10,171	10,181
第4計算期間末日	（2021年 2月24日）	2,282,398,779	2,284,645,642	10,158	10,168
第5計算期間末日	（2021年 3月23日）	2,803,223,973	2,805,920,566	10,395	10,405

第6計算期間末日	(2021年 4月23日)	3,283,668,765	3,313,513,628	11,002	11,102
第7計算期間末日	(2021年 5月24日)	3,449,754,230	3,465,724,759	10,800	10,850
第8計算期間末日	(2021年 6月23日)	3,497,549,021	3,513,499,778	10,964	11,014
第9計算期間末日	(2021年 7月26日)	3,784,908,819	3,818,355,365	11,316	11,416
第10計算期間末日	(2021年 8月23日)	4,238,700,194	4,276,450,700	11,228	11,328
第11計算期間末日	(2021年 9月24日)	4,908,190,434	4,952,076,440	11,184	11,284
第12計算期間末日	(2021年10月25日)	5,461,197,666	5,510,130,856	11,161	11,261
第13計算期間末日	(2021年11月24日)	6,160,660,941	6,215,741,717	11,185	11,285
第14計算期間末日	(2021年12月23日)	6,895,246,898	6,955,401,676	11,463	11,563
第15計算期間末日	(2022年 1月24日)	6,540,171,541	6,600,584,649	10,826	10,926
第16計算期間末日	(2022年 2月24日)	6,489,471,240	6,520,822,985	10,349	10,399
第17計算期間末日	(2022年 3月23日)	6,851,764,389	6,858,327,113	10,440	10,450
第18計算期間末日	(2022年 4月25日)	7,583,382,834	7,620,580,076	10,193	10,243
第19計算期間末日	(2022年 5月23日)	7,404,657,891	7,404,657,891	9,661	9,661
第20計算期間末日	(2022年 6月23日)	7,256,469,445	7,256,469,445	9,353	9,353
第21計算期間末日	(2022年 7月25日)	7,704,194,322	7,704,194,322	9,799	9,799
第22計算期間末日	(2022年 8月23日)	7,741,926,313	7,749,614,473	10,070	10,080
第23計算期間末日	(2022年 9月26日)	6,491,886,489	6,491,886,489	9,015	9,015
第24計算期間末日	(2022年10月24日)	6,485,376,412	6,485,376,412	8,867	8,867
第25計算期間末日	(2022年11月24日)	7,119,746,805	7,119,746,805	9,554	9,554
第26計算期間末日	(2022年12月23日)	6,958,955,330	6,958,955,330	9,313	9,313
第27計算期間末日	(2023年 1月23日)	7,639,799,826	7,639,799,826	9,653	9,653
第28計算期間末日	(2023年 2月24日)	7,529,494,542	7,529,494,542	9,483	9,483
第29計算期間末日	(2023年 3月23日)	7,275,548,381	7,275,548,381	9,386	9,386
第30計算期間末日	(2023年 4月24日)	7,666,158,745	7,666,158,745	9,908	9,908
第31計算期間末日	(2023年 5月23日)	7,528,060,153	7,528,060,153	9,886	9,886
第32計算期間末日	(2023年 6月23日)	7,241,284,349	7,241,284,349	9,912	9,912
第33計算期間末日	(2023年 7月24日)	7,319,127,837	7,326,354,872	10,127	10,137
第34計算期間末日	(2023年 8月23日)	6,942,366,950	6,942,366,950	9,793	9,793
第35計算期間末日	(2023年 9月25日)	6,286,684,732	6,286,684,732	9,648	9,648
第36計算期間末日	(2023年10月23日)	5,676,220,297	5,676,220,297	9,379	9,379
第37計算期間末日	(2023年11月24日)	5,723,628,028	5,723,628,028	9,867	9,867
第38計算期間末日	(2023年12月25日)	5,702,550,935	5,708,240,998	10,022	10,032
第39計算期間末日	(2024年 1月23日)	5,700,196,101	5,705,805,812	10,161	10,171
第40計算期間末日	(2024年 2月26日)	5,850,203,330	5,855,724,781	10,595	10,605
第41計算期間末日	(2024年 3月25日)	5,496,642,800	5,501,944,472	10,368	10,378
第42計算期間末日	(2024年 4月23日)	5,024,935,650	5,024,935,650	9,917	9,917
第43計算期間末日	(2024年 5月23日)	4,914,330,776	4,919,138,316	10,222	10,232
第44計算期間末日	(2024年 6月24日)	4,745,380,484	4,750,057,629	10,146	10,156
第45計算期間末日	(2024年 7月23日)	4,596,792,222	4,601,297,453	10,203	10,213
第46計算期間末日	(2024年 8月23日)	4,525,650,504	4,530,020,678	10,356	10,366
	2023年 8月末日	7,072,920,256	—	10,059	—
	9月末日	6,151,134,935	—	9,496	—

10月末日	5,498,285,492	—	9,192	—
11月末日	5,659,096,730	—	9,827	—
12月末日	5,718,999,351	—	10,071	—
2024年 1月末日	5,824,420,641	—	10,363	—
2月末日	5,785,152,166	—	10,485	—
3月末日	5,505,514,669	—	10,410	—
4月末日	4,959,201,101	—	9,912	—
5月末日	4,712,164,998	—	9,841	—
6月末日	4,663,851,796	—	10,073	—
7月末日	4,629,254,585	—	10,274	—
8月末日	4,586,176,888	—	10,472	—

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	0円
第2計算期間	10円
第3計算期間	10円
第4計算期間	10円
第5計算期間	10円
第6計算期間	100円
第7計算期間	50円
第8計算期間	50円
第9計算期間	100円
第10計算期間	100円
第11計算期間	100円
第12計算期間	100円
第13計算期間	100円
第14計算期間	100円
第15計算期間	100円
第16計算期間	50円
第17計算期間	10円
第18計算期間	50円
第19計算期間	0円
第20計算期間	0円
第21計算期間	0円
第22計算期間	10円
第23計算期間	0円
第24計算期間	0円
第25計算期間	0円
第26計算期間	0円
第27計算期間	0円
第28計算期間	0円
第29計算期間	0円

第30計算期間	0円
第31計算期間	0円
第32計算期間	0円
第33計算期間	10円
第34計算期間	0円
第35計算期間	0円
第36計算期間	0円
第37計算期間	0円
第38計算期間	10円
第39計算期間	10円
第40計算期間	10円
第41計算期間	10円
第42計算期間	0円
第43計算期間	10円
第44計算期間	10円
第45計算期間	10円
第46計算期間	10円

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	0.01
第2計算期間	2.29
第3計算期間	0.36
第4計算期間	0.02
第5計算期間	2.43
第6計算期間	6.80
第7計算期間	1.38
第8計算期間	1.98
第9計算期間	4.12
第10計算期間	0.10
第11計算期間	0.49
第12計算期間	0.68
第13計算期間	1.11
第14計算期間	3.37
第15計算期間	4.68
第16計算期間	3.94
第17計算期間	0.97
第18計算期間	1.88
第19計算期間	5.21
第20計算期間	3.18
第21計算期間	4.76
第22計算期間	2.86
第23計算期間	10.47

第24計算期間	1.64
第25計算期間	7.74
第26計算期間	2.52
第27計算期間	3.65
第28計算期間	1.76
第29計算期間	1.02
第30計算期間	5.56
第31計算期間	0.22
第32計算期間	0.26
第33計算期間	2.26
第34計算期間	3.29
第35計算期間	1.48
第36計算期間	2.78
第37計算期間	5.20
第38計算期間	1.67
第39計算期間	1.48
第40計算期間	4.36
第41計算期間	2.04
第42計算期間	4.34
第43計算期間	3.17
第44計算期間	0.64
第45計算期間	0.66
第46計算期間	1.59

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	1,332,928,932	—	1,332,928,932
第2計算期間	522,479,813	1,020,307	1,854,388,438
第3計算期間	223,101,450	—	2,077,489,888
第4計算期間	169,700,920	327,379	2,246,863,429
第5計算期間	456,401,903	6,671,875	2,696,593,457
第6計算期間	327,511,388	39,618,533	2,984,486,312
第7計算期間	209,633,109	13,449	3,194,105,972
第8計算期間	187,605,633	191,560,163	3,190,151,442
第9計算期間	185,217,560	30,714,346	3,344,654,656
第10計算期間	431,172,953	776,963	3,775,050,646
第11計算期間	615,553,162	2,003,198	4,388,600,610
第12計算期間	519,715,778	14,997,314	4,893,319,074
第13計算期間	656,728,725	41,970,159	5,508,077,640
第14計算期間	535,276,146	27,875,978	6,015,477,808
第15計算期間	418,803,203	392,970,169	6,041,310,842
第16計算期間	269,586,865	40,548,706	6,270,349,001

第17計算期間	439,448,326	147,073,161	6,562,724,166
第18計算期間	896,017,402	19,292,984	7,439,448,584
第19計算期間	298,788,299	73,683,943	7,664,552,940
第20計算期間	253,815,398	159,806,057	7,758,562,281
第21計算期間	139,579,048	35,594,132	7,862,547,197
第22計算期間	100,058,105	274,444,762	7,688,160,540
第23計算期間	241,323,187	728,015,113	7,201,468,614
第24計算期間	192,154,376	79,243,525	7,314,379,465
第25計算期間	204,439,677	67,070,811	7,451,748,331
第26計算期間	109,090,340	88,491,900	7,472,346,771
第27計算期間	556,913,769	114,832,137	7,914,428,403
第28計算期間	133,735,175	108,205,173	7,939,958,405
第29計算期間	29,279,833	218,011,138	7,751,227,100
第30計算期間	91,663,332	105,606,916	7,737,283,516
第31計算期間	1,212,623	123,717,974	7,614,778,165
第32計算期間	76,202,880	385,051,538	7,305,929,507
第33計算期間	40,716,984	119,611,056	7,227,035,435
第34計算期間	47,754,087	185,618,329	7,089,171,193
第35計算期間	11,543,777	584,334,679	6,516,380,291
第36計算期間	18,937,668	483,147,459	6,052,170,500
第37計算期間	6,505,898	257,832,470	5,800,843,928
第38計算期間	63,241,252	174,022,166	5,690,063,014
第39計算期間	14,890,410	95,242,316	5,609,711,108
第40計算期間	54,310,228	142,570,175	5,521,451,161
第41計算期間	63,487,990	283,266,177	5,301,672,974
第42計算期間	2,600,083	237,252,947	5,067,020,110
第43計算期間	949,540	260,429,492	4,807,540,158
第44計算期間	8,083,949	138,478,146	4,677,145,961
第45計算期間	462,792	172,377,035	4,505,231,718
第46計算期間	424,093	135,481,170	4,370,174,641

【モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン（為替ヘッジなし）予想分配金提示型】

（１）【投資状況】

2024年 8月30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	100,881,406,738	99.14
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	874,811,355	0.86
純資産総額		101,756,218,093	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 8月30日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン マ ザーファンド	14,186,469,989	7.0880	100,555,083,373	7.1111	100,881,406,738	99.14

（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 8月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.14
合計	99.14

（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8月末日、同日前 1 年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

		純資産総額		基準価額 （1万口当たりの純資産価額）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間末日	（2020年11月24日）	1,329,794,249	1,331,124,610	9,996	10,006
第2計算期間末日	（2020年12月23日）	1,888,791,159	1,890,647,958	10,172	10,182
第3計算期間末日	（2021年 1月25日）	1,971,438,568	1,973,375,014	10,181	10,191
第4計算期間末日	（2021年 2月24日）	2,172,638,532	2,174,735,559	10,361	10,371
第5計算期間末日	（2021年 3月23日）	2,302,580,531	2,313,196,423	10,845	10,895
第6計算期間末日	（2021年 4月23日）	2,744,338,087	2,768,353,272	11,428	11,528
第7計算期間末日	（2021年 5月24日）	3,182,404,700	3,210,492,201	11,330	11,430
第8計算期間末日	（2021年 6月23日）	4,361,206,158	4,398,866,360	11,580	11,680
第9計算期間末日	（2021年 7月26日）	5,970,103,562	6,020,301,026	11,893	11,993
第10計算期間末日	（2021年 8月23日）	6,745,640,472	6,803,184,451	11,723	11,823
第11計算期間末日	（2021年 9月24日）	8,070,934,522	8,139,593,416	11,755	11,855
第12計算期間末日	（2021年10月25日）	9,416,028,227	9,533,412,116	12,032	12,182
第13計算期間末日	（2021年11月24日）	10,933,875,358	11,069,711,777	12,074	12,224
第14計算期間末日	（2021年12月23日）	13,133,494,762	13,294,448,117	12,240	12,390
第15計算期間末日	（2022年 1月24日）	14,767,650,156	14,895,584,581	11,543	11,643
第16計算期間末日	（2022年 2月24日）	16,672,418,231	16,822,966,253	11,074	11,174

第17計算期間末日	(2022年 3月23日)	19,575,943,556	19,744,372,181	11,623	11,723
第18計算期間末日	(2022年 4月25日)	23,293,506,504	23,587,516,778	11,884	12,034
第19計算期間末日	(2022年 5月23日)	23,906,186,674	24,123,256,361	11,013	11,113
第20計算期間末日	(2022年 6月23日)	28,706,433,639	28,962,054,132	11,230	11,330
第21計算期間末日	(2022年 7月25日)	32,643,430,106	32,923,531,680	11,654	11,754
第22計算期間末日	(2022年 8月23日)	35,848,399,792	36,301,298,640	11,873	12,023
第23計算期間末日	(2022年 9月26日)	36,670,172,812	37,006,371,970	10,907	11,007
第24計算期間末日	(2022年10月24日)	39,920,787,615	40,280,155,445	11,109	11,209
第25計算期間末日	(2022年11月24日)	44,156,239,483	44,545,898,347	11,332	11,432
第26計算期間末日	(2022年12月23日)	43,790,139,409	43,997,640,151	10,552	10,602
第27計算期間末日	(2023年 1月23日)	45,205,945,831	45,416,575,609	10,731	10,781
第28計算期間末日	(2023年 2月24日)	47,533,633,326	47,752,882,048	10,840	10,890
第29計算期間末日	(2023年 3月23日)	47,039,630,017	47,263,111,951	10,524	10,574
第30計算期間末日	(2023年 4月24日)	51,839,387,713	52,295,422,075	11,367	11,467
第31計算期間末日	(2023年 5月23日)	54,496,260,263	54,965,815,348	11,606	11,706
第32計算期間末日	(2023年 6月23日)	61,856,282,109	62,631,405,917	11,970	12,120
第33計算期間末日	(2023年 7月24日)	67,621,619,867	68,461,632,877	12,075	12,225
第34計算期間末日	(2023年 8月23日)	71,659,588,455	72,568,807,317	11,822	11,972
第35計算期間末日	(2023年 9月25日)	77,575,717,319	78,236,129,115	11,747	11,847
第36計算期間末日	(2023年10月23日)	79,451,857,800	80,145,537,953	11,454	11,554
第37計算期間末日	(2023年11月24日)	86,830,032,419	87,548,387,929	12,087	12,187
第38計算期間末日	(2023年12月25日)	86,387,059,678	87,126,307,936	11,686	11,786
第39計算期間末日	(2024年 1月23日)	92,090,517,965	93,219,689,591	12,233	12,383
第40計算期間末日	(2024年 2月26日)	98,842,738,986	99,996,146,097	12,854	13,004
第41計算期間末日	(2024年 3月25日)	99,188,371,194	100,372,449,403	12,565	12,715
第42計算期間末日	(2024年 4月23日)	97,705,059,973	98,913,470,910	12,128	12,278
第43計算期間末日	(2024年 5月23日)	102,940,852,629	104,161,778,835	12,647	12,797
第44計算期間末日	(2024年 6月24日)	105,150,115,783	106,394,909,295	12,671	12,821
第45計算期間末日	(2024年 7月23日)	104,173,705,748	105,425,848,120	12,479	12,629
第46計算期間末日	(2024年 8月23日)	100,984,846,132	101,835,465,699	11,872	11,972
2023年 8月末日		75,814,977,452	—	12,214	—
9月末日		78,246,463,590	—	11,629	—
10月末日		78,753,647,223	—	11,211	—
11月末日		85,951,138,063	—	11,875	—
12月末日		87,490,836,707	—	11,741	—
2024年 1月末日		94,480,578,162	—	12,438	—
2月末日		98,591,416,336	—	12,750	—
3月末日		100,273,977,586	—	12,620	—
4月末日		99,730,675,858	—	12,318	—
5月末日		99,737,906,133	—	12,170	—
6月末日		105,645,908,673	—	12,676	—
7月末日		103,039,871,395	—	12,236	—
8月末日		101,756,218,093	—	11,905	—

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	10円
第2計算期間	10円
第3計算期間	10円
第4計算期間	10円
第5計算期間	50円
第6計算期間	100円
第7計算期間	100円
第8計算期間	100円
第9計算期間	100円
第10計算期間	100円
第11計算期間	100円
第12計算期間	150円
第13計算期間	150円
第14計算期間	150円
第15計算期間	100円
第16計算期間	100円
第17計算期間	100円
第18計算期間	150円
第19計算期間	100円
第20計算期間	100円
第21計算期間	100円
第22計算期間	150円
第23計算期間	100円
第24計算期間	100円
第25計算期間	100円
第26計算期間	50円
第27計算期間	50円
第28計算期間	50円
第29計算期間	50円
第30計算期間	100円
第31計算期間	100円
第32計算期間	150円
第33計算期間	150円
第34計算期間	150円
第35計算期間	100円
第36計算期間	100円
第37計算期間	100円
第38計算期間	100円
第39計算期間	150円
第40計算期間	150円

第41計算期間	150円
第42計算期間	150円
第43計算期間	150円
第44計算期間	150円
第45計算期間	150円
第46計算期間	100円

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	0.06
第2計算期間	1.86
第3計算期間	0.18
第4計算期間	1.86
第5計算期間	5.15
第6計算期間	6.29
第7計算期間	0.01
第8計算期間	3.08
第9計算期間	3.56
第10計算期間	0.58
第11計算期間	1.12
第12計算期間	3.63
第13計算期間	1.59
第14計算期間	2.61
第15計算期間	4.87
第16計算期間	3.19
第17計算期間	5.86
第18計算期間	3.53
第19計算期間	6.48
第20計算期間	2.87
第21計算期間	4.66
第22計算期間	3.16
第23計算期間	7.29
第24計算期間	2.76
第25計算期間	2.90
第26計算期間	6.44
第27計算期間	2.17
第28計算期間	1.48
第29計算期間	2.45
第30計算期間	8.96
第31計算期間	2.98
第32計算期間	4.42
第33計算期間	2.13
第34計算期間	0.85

第35計算期間	0.21
第36計算期間	1.64
第37計算期間	6.39
第38計算期間	2.49
第39計算期間	5.96
第40計算期間	6.30
第41計算期間	1.08
第42計算期間	2.28
第43計算期間	5.51
第44計算期間	1.37
第45計算期間	0.33
第46計算期間	4.06

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	1,330,361,539	—	1,330,361,539
第2計算期間	532,564,141	6,126,603	1,856,799,077
第3計算期間	83,477,563	3,830,238	1,936,446,402
第4計算期間	186,557,827	25,976,289	2,097,027,940
第5計算期間	44,348,372	18,197,832	2,123,178,480
第6計算期間	278,436,440	96,344	2,401,518,576
第7計算期間	408,399,131	1,167,555	2,808,750,152
第8計算期間	1,056,374,462	99,104,338	3,766,020,276
第9計算期間	1,256,767,612	3,041,452	5,019,746,436
第10計算期間	761,763,487	27,111,979	5,754,397,944
第11計算期間	1,111,581,492	90,000	6,865,889,436
第12計算期間	971,599,280	11,896,101	7,825,592,615
第13計算期間	1,261,154,241	30,985,540	9,055,761,316
第14計算期間	1,772,394,405	97,932,050	10,730,223,671
第15計算期間	2,274,646,088	211,427,178	12,793,442,581
第16計算期間	2,289,585,739	28,226,051	15,054,802,269
第17計算期間	1,990,307,058	202,246,738	16,842,862,589
第18計算期間	2,789,968,056	32,145,669	19,600,684,976
第19計算期間	2,285,729,756	179,445,956	21,706,968,776
第20計算期間	3,968,544,983	113,464,443	25,562,049,316
第21計算期間	2,536,113,180	88,005,082	28,010,157,414
第22計算期間	2,355,166,337	172,067,189	30,193,256,562
第23計算期間	3,987,813,116	561,153,834	33,619,915,844
第24計算期間	2,463,986,674	147,119,454	35,936,783,064
第25計算期間	3,271,115,650	242,012,249	38,965,886,465
第26計算期間	2,919,626,700	385,364,686	41,500,148,479
第27計算期間	1,284,385,140	658,577,950	42,125,955,669

第28計算期間	2,140,154,099	416,365,317	43,849,744,451
第29計算期間	1,249,364,279	402,721,930	44,696,386,800
第30計算期間	1,566,420,971	659,371,502	45,603,436,269
第31計算期間	2,074,068,363	721,996,071	46,955,508,561
第32計算期間	5,408,571,807	689,159,833	51,674,920,535
第33計算期間	4,917,537,650	591,590,807	56,000,867,378
第34計算期間	5,379,022,771	765,299,307	60,614,590,842
第35計算期間	6,378,591,600	952,002,765	66,041,179,677
第36計算期間	3,728,138,549	401,302,904	69,368,015,322
第37計算期間	2,983,062,807	515,527,040	71,835,551,089
第38計算期間	2,977,053,950	887,779,228	73,924,825,811
第39計算期間	1,700,240,801	346,958,203	75,278,108,409
第40計算期間	2,533,634,030	917,934,979	76,893,807,460
第41計算期間	2,892,105,848	847,365,977	78,938,547,331
第42計算期間	2,531,119,837	908,937,993	80,560,729,175
第43計算期間	1,871,743,571	1,037,392,289	81,395,080,457
第44計算期間	2,478,559,030	887,405,300	82,986,234,187
第45計算期間	2,199,726,282	1,709,802,289	83,476,158,180
第46計算期間	2,369,557,854	783,759,305	85,061,956,729

（参考）

モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン マザーファンド

投資状況

2024年 8月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	アメリカ	385,631,059,768	75.63
	イギリス	48,630,102,265	9.54
	ドイツ	35,007,234,512	6.87
	フランス	26,106,437,454	5.12
	オランダ	5,422,266,197	1.06
	小計	500,797,100,196	98.22
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	9,100,085,197	1.78
純資産総額		509,897,185,393	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 8月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
------	----	-----	----	----	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------

アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア・ サービス	641,316	60,171.63	38,589,035,478	59,819.77	38,363,379,465	7.52
ドイツ	株式	SAP SE	ソフト ウェア・ サービス	1,096,348	31,532.87	34,571,007,291	31,930.76	35,007,234,512	6.87
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サー ビス	725,422	38,797.71	28,144,713,834	39,721.53	28,814,876,088	5.65
アメリカ	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフト ウェア・ サービス	480,737	47,866.53	23,011,214,917	49,262.40	23,682,262,235	4.64
アメリカ	株式	AON PLC-CLASS A	保険	366,548	49,179.87	18,026,783,722	49,733.00	18,229,534,616	3.58
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケ ア機器・ サービス	212,690	83,798.65	17,823,136,145	85,659.33	18,218,884,174	3.57
アメリカ	株式	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	金融サー ビス	716,413	22,965.28	16,452,625,141	23,199.85	16,620,678,437	3.26
アメリカ	株式	BECTON DICKINSON AND CO	ヘルスケ ア機器・ サービス	472,743	34,071.44	16,107,034,760	34,892.45	16,495,164,327	3.23
アメリカ	株式	ABBOTT LABORATORIES	ヘルスケ ア機器・ サービス	977,424	16,232.08	15,865,624,562	16,327.64	15,959,035,019	3.13
アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	177,249	87,438.92	15,498,462,549	88,571.26	15,699,167,973	3.08
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲 料・タバ コ	1,435,282	10,038.98	14,408,773,034	10,432.84	14,974,067,461	2.94
アメリカ	株式	ARTHUR J GALLAGHER & CO	保険	337,595	42,255.53	14,265,257,676	42,204.85	14,248,148,361	2.79
アメリカ	株式	AUTOMATIC DATA PROCESSING	商業・専 門サービ ス	354,677	39,006.22	13,834,610,509	39,582.52	14,039,012,283	2.75
イギリス	株式	RELX PLC	商業・専 門サービ ス	1,921,197	6,712.64	12,896,303,831	6,823.24	13,108,799,746	2.57
イギリス	株式	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	家庭用 品・パー ソナル用 品	1,544,284	8,177.21	12,627,943,833	8,274.47	12,778,136,262	2.51
アメリカ	株式	ROPER TECHNOLOGIES INC	ソフト ウェア・ サービス	157,516	79,056.45	12,452,656,723	80,193.13	12,631,702,010	2.48
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用 品・パー ソナル用 品	464,640	24,637.72	11,447,670,221	24,620.34	11,439,596,636	2.24
アメリカ	株式	EQUIFAX INC	商業・専 門サービ ス	244,416	42,925.95	10,491,791,439	43,994.58	10,752,980,243	2.11
アメリカ	株式	BOOKING HOLDINGS INC	消費者 サービス	18,891	546,481.52	10,323,582,422	563,389.28	10,642,987,040	2.09
アメリカ	株式	CONSTELLATION BRANDS INC-A	食品・飲 料・タバ コ	307,219	35,287.75	10,841,070,339	34,458.05	10,586,169,506	2.08
アメリカ	株式	CME GROUP INC	金融サー ビス	339,471	30,352.97	10,303,955,115	31,001.67	10,524,171,311	2.06
イギリス	株式	HALEON PLC	家庭用 品・パー ソナル用 品	14,418,123	709.40	10,228,274,129	721.22	10,398,745,363	2.04
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲 料・タバ コ	577,363	17,390.47	10,040,619,704	17,745.23	10,245,445,002	2.01
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディ ア・娯楽	423,259	23,718.23	10,038,958,544	23,425.74	9,915,156,980	1.94

フランス	株式	PERNOD RICARD SA	食品・飲料・タバコ	454,837	20,127.19	9,154,594,357	21,041.70	9,570,546,432	1.88
イギリス	株式	EXPERIAN PLC	商業・専門サービス	1,261,754	6,947.20	8,765,658,650	7,061.62	8,910,028,543	1.75
フランス	株式	L'OREAL	家庭用品・パーソナル用品	135,426	62,932.58	8,522,708,933	63,943.36	8,659,593,742	1.70
アメリカ	株式	CDW CORP/DE	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	261,849	32,607.51	8,538,244,410	32,307.77	8,459,758,838	1.66
アメリカ	株式	OTIS WORLDWIDE CORP	資本財	605,624	13,570.65	8,218,714,969	13,586.58	8,228,361,348	1.61
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON	耐久消費財・アパレル	72,471	108,778.31	7,883,273,628	108,682.05	7,876,297,280	1.54

（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 8月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	資本財	1.61
	商業・専門サービス	11.28
	耐久消費財・アパレル	1.54
	消費者サービス	2.09
	メディア・娯楽	2.77
	一般消費財・サービス流通・小売り	1.54
	食品・飲料・タバコ	9.13
	家庭用品・パーソナル用品	8.49
	ヘルスケア機器・サービス	12.78
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.99
	金融サービス	13.45
	保険	6.37
	ソフトウェア・サービス	21.51
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.66
小計		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

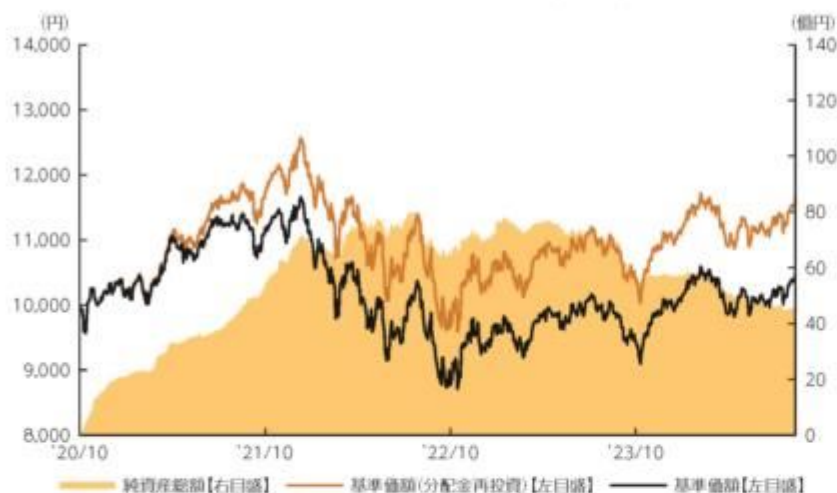


運用実績

2024年8月30日現在

為替ヘッジあり

■ 基準価額・純資産の推移 2020年10月21日(設定日)～2024年8月30日



- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は10,000を起点として表示
- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■ 基準価額・純資産

基準価額	10,472円
純資産総額	45.8億円

・純資産総額は表示桁未満切捨て

■ 分配の推移

2024年8月	10円
2024年7月	10円
2024年6月	10円
2024年5月	10円
2024年4月	0円
2024年3月	10円
直近1年間累計	80円
設定来累計	1,150円

・分配金は1万口当たり、税引前

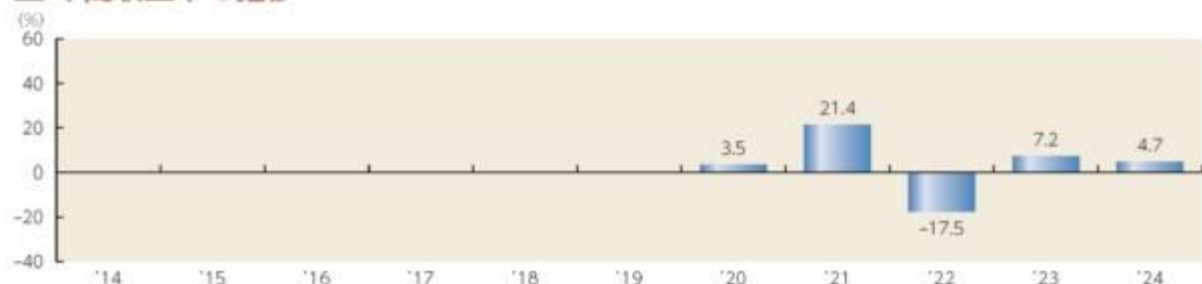
■ 主要な資産の状況

組入通貨	比率
1 円	97.9%
その他	2.1%

組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
1 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	7.3%
2 SAP SE	ソフトウェア・サービス	ドイツ	6.7%
3 VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	アメリカ	5.5%
4 ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	アメリカ	4.5%
5 AON PLC-CLASS A	保険	アメリカ	3.5%
6 UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	アメリカ	3.5%
7 INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	金融サービス	アメリカ	3.2%
8 BECTON DICKINSON AND CO	ヘルスケア機器・サービス	アメリカ	3.1%
9 ABBOTT LABORATORIES	ヘルスケア機器・サービス	アメリカ	3.0%
10 THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品/バイオテクノロジー/ライフサイエンス	アメリカ	3.0%

- ・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)
- ・外国株式の業種は、GICS(世界産業分類基準)によるもの。Global Industry Classification Standard ("GICS")は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。
- ・「国・地域」は原則、発行通貨ベースで分類しています。(ただし、発行通貨がユーロの場合は発行地)

■ 年間収益率の推移

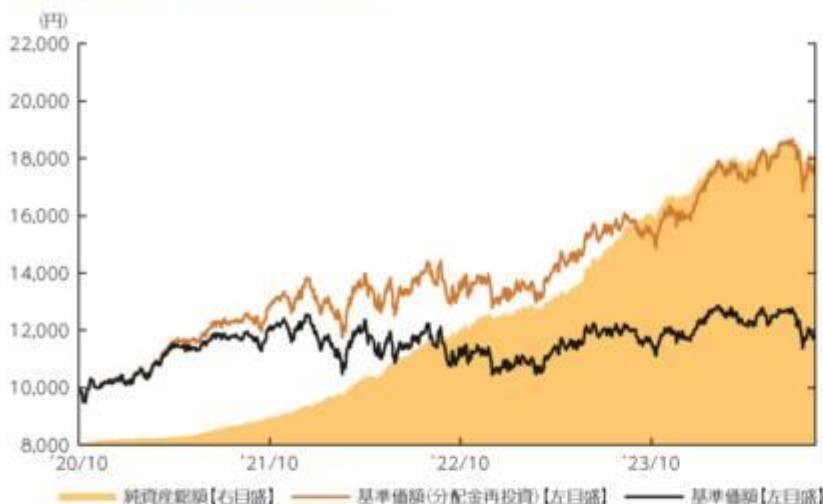


- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2020年は設定日から年末までの、2024年は年初から8月30日までの収益率を表示
- ・ファンドにベンチマークはありません。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。
運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。

為替ヘッジなし

■ 基準価額・純資産の推移 2020年10月21日(設定日)～2024年8月30日



- 基準価額、基準価額(分配金再投資)は10,000を起点として表示
- 基準価額、基準価額(分配金再投資)は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■ 基準価額・純資産

基準価額	11,905円
純資産総額	1,017億円

● 純資産総額は表示桁未満切捨て

■ 分配の推移

2024年 8 月	100円
2024年 7 月	150円
2024年 6 月	150円
2024年 5 月	150円
2024年 4 月	150円
2024年 3 月	150円
直近1年間累計	1,550円
設定来累計	4,740円

● 分配金は1万口当たり、税引前

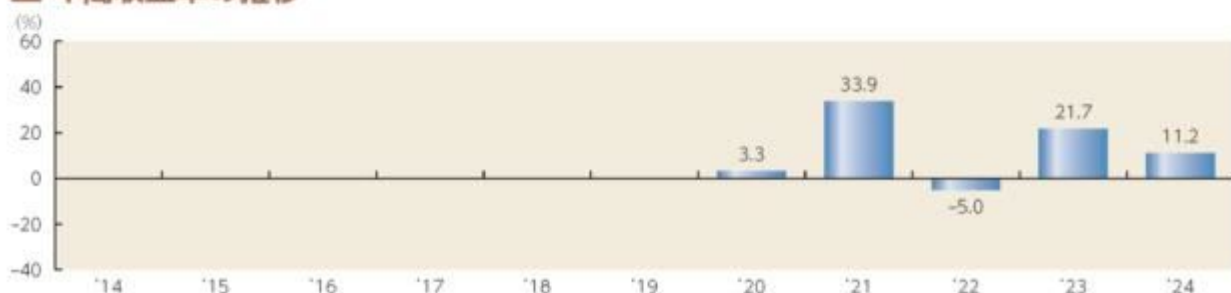
■ 主要な資産の状況

組入上位通貨	比率
1 アメリカドル	75.7%
2 ユーロ	13.6%
3 イギリスポンド	8.9%
4 円	1.9%
5 スウェーデンクローネ	0.0%
6 スイスフラン	0.0%

組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
1 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	7.5%
2 SAP SE	ソフトウェア・サービス	ドイツ	6.8%
3 VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	アメリカ	5.6%
4 ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	アメリカ	4.6%
5 AON PLC-CLASS A	保険	アメリカ	3.5%
6 UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	アメリカ	3.5%
7 INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	金融サービス	アメリカ	3.2%
8 BECTON DICKINSON AND CO	ヘルスケア機器・サービス	アメリカ	3.2%
9 ABBOTT LABORATORIES	ヘルスケア機器・サービス	アメリカ	3.1%
10 THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	アメリカ	3.1%

- 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)
- 外国株式の業種は、GICS(世界産業分類基準)によるもの。Global Industry Classification Standard ("GICS")は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。
- 「国・地域」は原則、発行通貨ベースで分類しています。(ただし、発行通貨がユーロの場合は発行地)

■ 年間収益率の推移



- 収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- 2020年は設定日から年末までの、2024年は年初から8月30日までの収益率を表示
- ファンドにベンチマークはありません。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。
運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 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。

ただし、以下の日は申込みができません。

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

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いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

申込手数料

申込価額（発行価格）×3.30%（税抜 3.00%）を上限として販売会社が定める手数料率

申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があり、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

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、申込金額および申込手数料（税込）を販売会社が定める日までに支払うものとします。

なお、申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があります。申込みコースの取扱い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。

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

申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

<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。

ただし、以下の日は申込みができません。

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

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

申込価額（発行価格）×3.30%（税抜 3.00%）を上限として販売会社が定める手数料率

申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があり、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額および申込手数料（税込）を販売会社が定める日までに支払うものとします。

なお、申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があります。申込みコースの取扱い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。

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

申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

< 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。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

受益者の解約請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

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。

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の受付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。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

受益者の解約請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

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の受付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2月27日から2024年8月23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】

【モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン（為替ヘッジあり）予想分配金提示型】

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 [2024年 2月26日現在]	当期 [2024年 8月23日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	184,066,536	126,327,051
親投資信託受益証券	5,686,683,021	4,400,428,807
派生商品評価勘定	-	23,346,288
未収入金	24,381,102	-
未収利息	-	761
流動資産合計	5,895,130,659	4,550,102,907
資産合計	5,895,130,659	4,550,102,907
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	16,544,063	12,437,264
未払金	118,852	-
未払収益分配金	5,521,451	4,370,174
未払解約金	12,088,983	-
未払受託者報酬	295,354	211,937
未払委託者報酬	10,337,363	7,417,781
未払利息	10	-
その他未払費用	21,253	15,247
流動負債合計	44,927,329	24,452,403
負債合計	44,927,329	24,452,403
純資産の部		
元本等		
元本	5,521,451,161	4,370,174,641
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	328,752,169	155,475,863
（分配準備積立金）	177,730,114	133,414,097
元本等合計	5,850,203,330	4,525,650,504
純資産合計	5,850,203,330	4,525,650,504
負債純資産合計	5,895,130,659	4,550,102,907

(2)【損益及び剰余金計算書】

	前期 自 2023年 8月24日 至 2024年 2月26日	当期 自 2024年 2月27日 至 2024年 8月23日
営業収益		
受取利息	-	59,425
有価証券売買等損益	863,282,235	9,865,668
為替差損益	352,652,789	72,800,213
営業収益合計	510,629,446	82,606,456
営業費用		
支払利息	21,617	439
受託者報酬	1,671,506	1,336,824
委託者報酬	58,502,880	46,788,654
その他費用	1,392,440	1,195,310
営業費用合計	61,588,443	49,321,227
営業利益又は営業損失（ ）	449,041,003	131,927,683
経常利益又は経常損失（ ）	449,041,003	131,927,683
当期純利益又は当期純損失（ ）	449,041,003	131,927,683
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（ ）	230,408	10,655,809
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	146,804,243	328,752,169
剰余金増加額又は欠損金減少額	48,513,042	5,588,691
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	47,482,402	2,162,567
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,030,640	3,426,124
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,946,000	33,931,361
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,509,872	33,931,361
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,436,128	-
分配金	16,821,225	23,661,762
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	328,752,169	155,475,863

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。 ファンドの特定期間 当ファンドは、原則として毎年2月23日および8月23日を特定期間の末日としておりますが、前特定期間においては当該日が休業日のため、当特定期間は2024年 2月27日から2024年 8月23日までとなっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	前期 [2024年 2月26日現在]	当期 [2024年 8月23日現在]
1. 期首元本額	7,089,171,193円	5,521,451,161円
期中追加設定元本額	169,429,233円	76,008,447円
期中一部解約元本額	1,737,149,265円	1,227,284,967円
2. 受益権の総数	5,521,451,161口	4,370,174,641口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 2023年 8月24日 至 2024年 2月26日	当期 自 2024年 2月27日 至 2024年 8月23日
1. 運用に係る権限を委託するための費用	1. 運用に係る権限を委託するための費用

44/84

前期 自 2023年 8月24日 至 2024年 2月26日			当期 自 2024年 2月27日 至 2024年 8月23日		
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	—円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	—円
収益調整金額	C	511,598,118円	収益調整金額	C	414,471,465円
分配準備積立金額	D	187,147,300円	分配準備積立金額	D	138,431,251円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	702,283,701円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	555,984,719円
当ファンドの期末残存口数	F	5,609,711,108口	当ファンドの期末残存口数	F	4,505,231,718口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,251円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,234円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	5,609,711円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	4,505,231円
第40期 2024年 1月24日 2024年 2月26日			第46期 2024年 7月24日 2024年 8月23日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,845,075円	費用控除後の配当等収益額	A	4,895,930円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	—円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	—円
収益調整金額	C	505,307,495円	収益調整金額	C	402,059,216円
分配準備積立金額	D	180,406,490円	分配準備積立金額	D	132,888,341円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	688,559,060円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	539,843,487円
当ファンドの期末残存口数	F	5,521,451,161口	当ファンドの期末残存口数	F	4,370,174,641口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,247円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,235円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	5,521,451円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	4,370,174円

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	前期 自 2023年 8月24日 至 2024年 2月26日	当期 自 2024年 2月27日 至 2024年 8月23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。 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。 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。	同左
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	前期 [2024年 2月26日現在]	当期 [2024年 8月23日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引

区分	前期 [2024年 2月26日現在]	当期 [2024年 8月23日現在]
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 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 （３）上記以外の金融商品 同左 同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	前期 [2024年 2月26日現在]	当期 [2024年 8月23日現在]
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）
親投資信託受益証券	351,451,241	167,694,536
合計	351,451,241	167,694,536

（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

前期 [2024年 2月26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 売建				
	アメリカドル	4,101,813,306	—	4,108,268,361	6,455,055
	イギリスポンド	499,060,455	—	503,024,855	3,964,400
	ユーロ	899,392,212	—	905,516,820	6,124,608
合計		5,500,265,973	—	5,516,810,036	16,544,063

当期 [2024年 8月23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 売建				
	アメリカドル	3,266,545,926	—	3,243,199,638	23,346,288
	イギリスポンド	390,024,275	—	397,116,304	7,092,029
	ユーロ	570,575,880	—	575,921,115	5,345,235
合計		4,227,146,081	—	4,216,237,057	10,909,024

（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ではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	前期 [2024年 2月26日現在]	当期 [2024年 8月23日現在]
1口当たり純資産額	1.0595円	1.0356円
(1万口当たり純資産額)	(10,595円)	(10,356円)

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン マザーファンド	620,757,929	4,400,428,807	
合 計		620,757,929	4,400,428,807	

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

【モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン（為替ヘッジなし）予想分配金提示型】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 [2024年 2月26日現在]	当期 [2024年 8月23日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,589,564,656	2,174,164,533
親投資信託受益証券	97,753,544,583	99,878,552,208
未収利息	-	13,104
流動資産合計	100,343,109,239	102,052,729,845
資産合計	100,343,109,239	102,052,729,845
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,153,407,111	850,619,567
未払解約金	170,884,286	47,081,131
未払受託者報酬	4,881,314	4,717,869
未払委託者報酬	170,845,957	165,125,469
未払利息	141	-
その他未払費用	351,444	339,677
流動負債合計	1,500,370,253	1,067,883,713
負債合計	1,500,370,253	1,067,883,713
純資産の部		
元本等		
元本	76,893,807,460	85,061,956,729
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	21,948,931,526	15,922,889,403
（分配準備積立金）	10,177,893,476	6,201,614,622

	前期 [2024年 2月26日現在]	当期 [2024年 8月23日現在]
元本等合計	98,842,738,986	100,984,846,132
純資産合計	98,842,738,986	100,984,846,132
負債純資産合計	100,343,109,239	102,052,729,845

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 2023年 8月24日 至 2024年 2月26日	当期 自 2024年 2月27日 至 2024年 8月23日
営業収益		
受取利息	-	414,210
有価証券売買等損益	13,774,194,832	72,364,476
営業収益合計	13,774,194,832	71,950,266
営業費用		
支払利息	100,555	2,985
受託者報酬	23,846,714	27,283,532
委託者報酬	834,634,613	954,923,631
その他費用	1,716,899	1,964,364
営業費用合計	860,298,781	984,174,512
営業利益又は営業損失 ()	12,913,896,051	1,056,124,778
経常利益又は経常損失 ()	12,913,896,051	1,056,124,778
当期純利益又は当期純損失 ()	12,913,896,051	1,056,124,778
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 ()	53,700,200	63,847,300
期首剰余金又は期首欠損金 ()	11,044,997,613	21,948,931,526
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,905,842,114	3,508,122,932
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,905,842,114	3,508,122,932
剰余金減少額又は欠損金増加額	767,829,598	1,580,916,774
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	767,829,598	1,580,916,774
分配金	5,094,274,454	6,960,970,803
期末剰余金又は期末欠損金 ()	21,948,931,526	15,922,889,403

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの特定期間 当ファンドは、原則として毎年2月23日および8月23日を特定期間の末日としておりますが、前特定期間においては当該日が休業日のため、当特定期間は2024年 2月27日から2024年 8月23日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	前期 [2024年 2月26日現在]	当期 [2024年 8月23日現在]
1. 期首元本額	60,614,590,842円	76,893,807,460円
期中追加設定元本額	20,300,721,737円	14,342,812,422円
期中一部解約元本額	4,021,505,119円	6,174,663,153円
2. 受益権の総数	76,893,807,460口	85,061,956,729口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2023年 8月24日 至 2024年 2月26日	当期 自 2024年 2月27日 至 2024年 8月23日
1. 運用に係る権限を委託するための費用	1. 運用に係る権限を委託するための費用

前期 自 2023年 8月24日 至 2024年 2月26日	当期 自 2024年 2月27日 至 2024年 8月23日																																																												
「モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式 オープン マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る 権限の全部または一部を委託するために要する費用として、 信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対 し、次に定める率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁 しております。 20億円以下の部分に対して 年1万分の80 20億円超40億円以下の部分に対して 年1万分の75 40億円超80億円以下の部分に対して 年1万分の70 80億円超の部分に対して 年1万分の65	「モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式 オープン マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る 権限の全部または一部を委託するために要する費用として、 信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対 し、次に定める率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁 しております。 20億円以下の部分に対して 年1万分の80 20億円超40億円以下の部分に対して 年1万分の75 40億円超80億円以下の部分に対して 年1万分の70 80億円超の部分に対して 年1万分の65																																																												
2. 分配金の計算過程	2. 分配金の計算過程																																																												
第35期 2023年 8月24日 2023年 9月25日	第41期 2024年 2月27日 2024年 3月25日																																																												
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>14,806,589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>12,754,548,985円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>3,129,839,007円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>15,899,194,581円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>66,041,179,677口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>2,407円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>100円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>660,411,796円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	14,806,589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	12,754,548,985円	分配準備積立金額	D	3,129,839,007円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	15,899,194,581円	当ファンドの期末残存口数	F	66,041,179,677口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,407円	1万口当たり分配金額	H	100円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	660,411,796円	<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>—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>16,358,097,099円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>10,067,862,510円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>26,425,959,609円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>78,938,547,331口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>3,347円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>150円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>1,184,078,209円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	—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	16,358,097,099円	分配準備積立金額	D	10,067,862,510円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	26,425,959,609円	当ファンドの期末残存口数	F	78,938,547,331口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,347円	1万口当たり分配金額	H	150円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,184,078,209円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	14,806,589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	12,754,548,985円																																																											
分配準備積立金額	D	3,129,839,007円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	15,899,194,581円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	66,041,179,677口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,407円																																																											
1万口当たり分配金額	H	100円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	660,411,796円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	—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	16,358,097,099円																																																											
分配準備積立金額	D	10,067,862,510円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	26,425,959,609円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	78,938,547,331口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,347円																																																											
1万口当たり分配金額	H	150円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,184,078,209円																																																											
第36期 2023年 9月26日 2023年10月23日	第42期 2024年 3月26日 2024年 4月23日																																																												
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>8,705,819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>13,540,289,341円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>2,469,591,956円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>16,018,587,116円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>69,368,015,322口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>2,309円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>100円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>693,680,153円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	8,705,819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	13,540,289,341円	分配準備積立金額	D	2,469,591,956円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	16,018,587,116円	当ファンドの期末残存口数	F	69,368,015,322口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,309円	1万口当たり分配金額	H	100円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	693,680,153円	<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>—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>16,980,574,139円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>8,783,114,283円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>25,763,688,422円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>80,560,729,175口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>3,198円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>150円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>1,208,410,937円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	—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	16,980,574,139円	分配準備積立金額	D	8,783,114,283円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	25,763,688,422円	当ファンドの期末残存口数	F	80,560,729,175口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,198円	1万口当たり分配金額	H	150円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,208,410,937円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	8,705,819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	13,540,289,341円																																																											
分配準備積立金額	D	2,469,591,956円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	16,018,587,116円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	69,368,015,322口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,309円																																																											
1万口当たり分配金額	H	100円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	693,680,153円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	—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	16,980,574,139円																																																											
分配準備積立金額	D	8,783,114,283円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	25,763,688,422円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	80,560,729,175口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,198円																																																											
1万口当たり分配金額	H	150円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,208,410,937円																																																											
第37期 2023年10月24日 2023年11月24日	第43期 2024年 4月24日 2024年 5月23日																																																												
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>49,980,613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>3,308,316,280円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>14,099,841,543円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>1,771,666,344円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>19,229,804,780円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>71,835,551,089口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>2,676円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>100円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>718,355,510円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	49,980,613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	3,308,316,280円	収益調整金額	C	14,099,841,543円	分配準備積立金額	D	1,771,666,344円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	19,229,804,780円	当ファンドの期末残存口数	F	71,835,551,089口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,676円	1万口当たり分配金額	H	100円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	718,355,510円	<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>210,879,232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>1,922,422,165円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>17,334,371,910円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>7,478,268,049円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>26,945,941,356円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>81,395,080,457口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>3,310円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>150円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>1,220,926,206円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	210,879,232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	1,922,422,165円	収益調整金額	C	17,334,371,910円	分配準備積立金額	D	7,478,268,049円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	26,945,941,356円	当ファンドの期末残存口数	F	81,395,080,457口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,310円	1万口当たり分配金額	H	150円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,220,926,206円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	49,980,613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	3,308,316,280円																																																											
収益調整金額	C	14,099,841,543円																																																											
分配準備積立金額	D	1,771,666,344円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	19,229,804,780円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	71,835,551,089口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,676円																																																											
1万口当たり分配金額	H	100円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	718,355,510円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	210,879,232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	1,922,422,165円																																																											
収益調整金額	C	17,334,371,910円																																																											
分配準備積立金額	D	7,478,268,049円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	26,945,941,356円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	81,395,080,457口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,310円																																																											
1万口当たり分配金額	H	150円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,220,926,206円																																																											
第38期 2023年11月25日 2023年12月25日	第44期 2024年 5月24日 2024年 6月24日																																																												
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>32,833,505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>14,696,567,913円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>4,358,070,091円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>19,087,471,509円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>73,924,825,811口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>2,582円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>100円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>739,248,258円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	32,833,505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	14,696,567,913円	分配準備積立金額	D	4,358,070,091円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	19,087,471,509円	当ファンドの期末残存口数	F	73,924,825,811口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,582円	1万口当たり分配金額	H	100円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	739,248,258円	<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>135,690,376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>1,352,492,698円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>17,930,356,013円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>8,300,527,566円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>27,719,066,653円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>82,986,234,187口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>3,340円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>150円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>1,244,793,512円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	135,690,376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	1,352,492,698円	収益調整金額	C	17,930,356,013円	分配準備積立金額	D	8,300,527,566円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	27,719,066,653円	当ファンドの期末残存口数	F	82,986,234,187口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,340円	1万口当たり分配金額	H	150円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,244,793,512円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	32,833,505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	14,696,567,913円																																																											
分配準備積立金額	D	4,358,070,091円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	19,087,471,509円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	73,924,825,811口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,582円																																																											
1万口当たり分配金額	H	100円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	739,248,258円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	135,690,376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	1,352,492,698円																																																											
収益調整金額	C	17,930,356,013円																																																											
分配準備積立金額	D	8,300,527,566円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	27,719,066,653円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	82,986,234,187口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,340円																																																											
1万口当たり分配金額	H	150円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,244,793,512円																																																											
第39期 2023年12月26日 2024年 1月23日	第45期 2024年 6月25日 2024年 7月23日																																																												
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>63,227,450円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	63,227,450円	<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>—円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	—円																																																
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	63,227,450円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	—円																																																											

前期 自 2023年 8月24日 至 2024年 2月26日			当期 自 2024年 2月27日 至 2024年 8月23日		
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	2,964,466,295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	15,050,246,394円	収益調整金額	C	18,262,127,930円
分配準備積立金額	D	3,634,723,842円	分配準備積立金額	D	8,370,264,736円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	21,712,663,981円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	26,632,392,666円
当ファンドの期末残存口数	F	75,278,108,409口	当ファンドの期末残存口数	F	83,476,158,180口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,884円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,190円
1万口当たり分配金額	H	150円	1万口当たり分配金額	H	150円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,129,171,626円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,252,142,372円
第40期 2024年 1月24日 2024年 2月26日			第46期 2024年 7月24日 2024年 8月23日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	50,003,276円	費用控除後の配当等収益額	A	—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	5,814,383,602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	15,559,423,749円	収益調整金額	C	18,812,268,818円
分配準備積立金額	D	5,466,913,709円	分配準備積立金額	D	7,052,234,189円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	26,890,724,336円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	25,864,503,007円
当ファンドの期末残存口数	F	76,893,807,460口	当ファンドの期末残存口数	F	85,061,956,729口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,497円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,040円
1万口当たり分配金額	H	150円	1万口当たり分配金額	H	100円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,153,407,111円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	850,619,567円

（金融商品に関する注記）
1 金融商品の状況に関する事項

区分	前期 自 2023年 8月24日 至 2024年 2月26日	当期 自 2024年 2月27日 至 2024年 8月23日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	前期 [2024年 2月26日現在]	当期 [2024年 8月23日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左

区分	前期 [2024年 2月26日現在]	当期 [2024年 8月23日現在]
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 [2024年 2月26日現在]	当期 [2024年 8月23日現在]
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）
親投資信託受益証券	6,013,865,060	4,043,723,126
合計	6,013,865,060	4,043,723,126

（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 [2024年 2月26日現在]	当期 [2024年 8月23日現在]
1口当たり純資産額	1.2854円	1.1872円
(1万口当たり純資産額)	(12,854円)	(11,872円)

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン マザーファンド	14,089,627,611	99,878,552,208	
合計		14,089,627,611	99,878,552,208	

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。

モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[2024年 8月23日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	3,811,282,385
コール・ローン	4,756,455,885
株式	499,884,425,189
派生商品評価勘定	1,239,225
未収入金	850,519,742
未収配当金	594,004,359
未収利息	28,669
流動資産合計	509,897,955,454
資産合計	509,897,955,454
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,681,115
未払金	1,530,930,248
未払解約金	1,457,170,538
流動負債合計	2,999,781,901
負債合計	2,999,781,901
純資産の部	
元本等	
元本	71,506,825,053
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	435,391,348,500
元本等合計	506,898,173,553
純資産合計	506,898,173,553
負債純資産合計	509,897,955,454

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	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 8月23日現在]
1. 期首	2024年 2月27日
期首元本額	69,114,539,778円
期中追加設定元本額	6,830,316,876円
期中一部解約元本額	4,438,031,601円
元本の内訳	
モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン（為替ヘッジあり）	7,942,579,277円
モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン（為替ヘッジなし）	46,502,939,768円
モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン（為替ヘッジあり）予想分配金提示型	620,757,929円
モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン（為替ヘッジなし）予想分配金提示型	14,089,627,611円
ビルドアップ型 MSグローバル・プレミアム株式（為替ヘッジなし）2020-11（限定追加型）	1,206,853,289円
ビルドアップ型 MSグローバル・プレミアム株式（為替ヘッジなし）2023-02（限定追加型）	1,100,089,158円

	[2024年 8月23日現在]
モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン<隔月決算型>（為替ヘッジあり）予想分配金提示型	1,771,607円
モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン<隔月決算型>（為替ヘッジなし）予想分配金提示型	42,206,414円
合計	71,506,825,053円
2. 受益権の総数	71,506,825,053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 2月27日 至 2024年 8月23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、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。 当ファンドは、ファンドの運用の指図に関する権限を再委託しております。この場合、再委託先で投資リスクに対する管理体制を構築しているほか、当該再委託先のリスクの管理体制や管理状況の確認を委託会社で行っております。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年 8月23日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[2024年 8月23日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	4,856,562,649
合計	4,856,562,649

(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 8月23日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカドル 売建 アメリカドル イギリスポンド ユーロ				
		299,175,502	—	300,414,727	1,239,225
		1,745,759,188	—	1,755,681,850	9,922,662
		257,485,283	—	259,101,922	1,616,639
		41,690,219	—	41,832,033	141,814
合計		2,344,110,192	—	2,357,030,532	10,441,890

（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ではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[2024年 8月23日現在]
1口当たり純資産額	7.0888円
(1万口当たり純資産額)	(70,888円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	OTIS WORLDWIDE CORP	605,624	93.72	56,759,081.28	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	354,677	269.38	95,542,890.26	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	236,787	210.22	49,777,363.14	
	EQUIFAX INC	244,416	296.45	72,457,123.20	
	BOOKING HOLDINGS INC	17,062	3,768.09	64,291,151.58	
	ALPHABET INC-CL A	423,259	163.80	69,329,824.20	
	AUTOZONE INC	16,949	3,170.89	53,743,414.61	
	COCA-COLA CO/THE	1,435,282	69.33	99,508,101.06	
	CONSTELLATION BRANDS INC-A	307,219	243.70	74,869,270.30	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	577,363	120.10	69,341,296.30	
	PROCTER & GAMBLE CO/THE	464,640	170.15	79,058,496.00	
	ABBOTT LABORATORIES	977,424	112.10	109,569,230.40	
	BECTON DICKINSON AND CO	472,743	235.30	111,236,427.90	
	HOLOGIC INC	671,630	80.09	53,790,846.70	
	STERIS PLC	192,202	234.14	45,002,176.28	

	UNITEDHEALTH GROUP INC	212,690	578.72	123,087,956.80	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	177,249	603.86	107,033,581.14	
	ZOETIS INC	174,735	182.17	31,831,474.95	
	CME GROUP INC	339,471	209.62	71,159,911.02	
	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	74,256	407.99	30,295,705.44	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	716,413	158.60	113,623,101.80	
	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	96,536	163.79	15,811,631.44	
	S&P GLOBAL INC	77,928	498.72	38,864,252.16	
	VISA INC-CLASS A SHARES	725,422	267.94	194,369,570.68	
	AON PLC-CLASS A	366,548	339.64	124,494,362.72	
	ARTHUR J GALLAGHER & CO	337,595	291.82	98,516,972.90	
	ACCENTURE PLC-CL A	480,737	330.57	158,917,230.09	
	MICROSOFT CORP	641,316	415.55	266,498,863.80	
	ROPER TECHNOLOGIES INC	157,516	545.97	85,999,010.52	
	CDW CORP/DE	261,849	225.19	58,965,776.31	
アメリカドル 小計		11,837,538		2,623,746,094.98 (383,775,341,312)	
イギリスポンド	EXPERIAN PLC	1,261,754	36.43	45,965,698.22	
	RELX PLC	2,073,763	35.20	72,996,457.60	
	HALEON PLC	15,024,956	3.72	55,952,936.14	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,544,284	42.88	66,218,897.92	
イギリスポンド 小計		19,904,757		241,133,989.88 (46,208,506,480)	
ユーロ	RELX PLC	540,439	41.46	22,406,600.94	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	72,471	678.00	49,135,338.00	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	1,097,610	23.10	25,354,791.00	
	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	887,465	8.06	7,154,742.83	
	PERNOD RICARD SA	454,837	125.45	57,059,301.65	
	L'OREAL	135,426	392.25	53,120,848.50	
	SAP SE	1,096,348	196.54	215,476,235.92	
ユーロ 小計		4,284,596		429,707,858.84 (69,900,577,397)	
合 計		36,026,891		499,884,425,189 (499,884,425,189)	

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の()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。

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 30銘柄	100.00%	76.77%
イギリスポンド	株式 4銘柄	100.00%	9.24%

ユーロ	株式	7銘柄	100.00%	13.98%
-----	----	-----	---------	--------

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】

【モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン（為替ヘッジあり）予想分配金提示型】

【純資産額計算書】

2024年 8月30日現在

（単位：円）

資産総額	4,645,831,932
負債総額	59,655,044
純資産総額（ - ）	4,586,176,888
発行済口数	4,379,655,783口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.0472
（10,000口当たり）	（10,472）

【モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン（為替ヘッジなし）予想分配金提示型】

【純資産額計算書】

2024年 8月30日現在

（単位：円）

資産総額	101,877,155,652
負債総額	120,937,559
純資産総額（ - ）	101,756,218,093
発行済口数	85,470,952,885口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.1905
（10,000口当たり）	（11,905）

（参考）

モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン マザーファンド

純資産額計算書

2024年 8月30日現在

（単位：円）

資産総額	509,928,953,315
負債総額	31,767,922
純資産総額（ - ）	509,897,185,393
発行済口数	71,703,952,273口
1口当たり純資産価額（ / ）	7.1111
（10,000口当たり）	（71,111）

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8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 8月30日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本 数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	826	36,181,337
追加型公社債投資信託	16	1,516,173
単位型株式投資信託	92	396,293
単位型公社債投資信託	46	102,306
合 計	980	38,196,110

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 (2023年3月31日現在)	第39期 (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 (2023年3月31日現在)	第39期 (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 (2023年3月31日現在)	第39期 (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 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 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 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 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 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)				
当期変動額合計	—	—	—	—
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712

	利益剰余金				株主資本合計
	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
別途 積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	342,589	6,998,000	29,000,498	36,341,088	83,073,932
当期変動額					
剰余金の配当			6,075,125	6,075,125	6,075,125
当期純利益			10,342,327	10,342,327	10,342,327
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)					

当期変動額合計	—	—	4,267,201	4,267,201	4,267,201
当期末残高	342,589	6,998,000	33,267,700	40,608,289	87,341,133

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

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 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
当期変動額				
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 当期変動額（純額）				
当期変動額合計	—	—	—	—
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712

	利益剰余金				株主資本合計
	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	342,589	6,998,000	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 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 有価証券 評価差額金	評価・換算 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 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 (2023年3月31日現在)	第39期 (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 (2023年3月31日現在)	第39期 (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 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 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 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 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 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 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 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 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つのグループिंग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 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	211,581	-	-	211,581
合計	211,581	-	-	211,581

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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 (2023年3月31日現在)	第39期 (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 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 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	51,733,041	-	-	-
金銭の信託	10,400,000	-	-	-
未収委託者報酬	16,753,855	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	1,579,691	4,859,714	1,433,213	-
合計	80,466,587	4,859,714	1,433,213	-

第39期(2024年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 有価証券	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 5年以内	5年超 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 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	8,983,713	7,558,314	1,425,399
	小計	8,983,713	7,558,314	1,425,399
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	15,018,343	15,474,760	456,417
	小計	15,018,343	15,474,760	456,417
合計		24,002,056	23,033,074	968,982

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

第39期(2024年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	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 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 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 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 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 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 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
積立型制度の 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 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 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 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 調整額	-	34,505
その他	1,600	2,196
確定給付制度に係る 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 (2023年3月31日現在)	第39期 (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 (2023年3月31日現在)	第39期 (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 (2023年3月31日現在)	第39期 (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 (2023年3月31日現在)	第39期 (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 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (注5)	科目	期末残高 (注5)
親会社	㈱三菱UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税等	連結納税等に 伴う支払 (注1)	3,947,200 千円	その他未払金	77,007 千円
親会社	三菱UFJ 信託銀行㈱	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	4,893,312 千円	未払手数料	790,279 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 (注3)	463,416 千円	未払費用	253,093 千円

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

親会社	三菱UFJ 信託銀行(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,006,309 千円	未払手数料	886,173 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 (注3)	463,831 千円	未払費用	260,800 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 名称	所在地	資本金	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (注2)	科目	期末残高 (注2)
同一の親会社を持つ会社	(株)三菱UFJ 銀行	東京都 千代田 区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注1)	4,052,979 千円	未払手数料	868,785 千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・ スタンレー 証券(株)	東京都 千代田 区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注1)	6,661,991 千円	未払手数料	1,218,051 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 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (注2)	科目	期末残高 (注2)
同一の親会社を持つ会社	(株)三菱UFJ 銀行	東京都 千代田 区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注1)	4,354,007 千円	未払手数料	1,028,586 千円

同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・ スタンレー 証券㈱	東京都 千代田 区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料 の支払 (注1)	7,493,449 千円	未払手数料	1,449,414 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 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 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 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 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：株式会社りそな銀行

（再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行）

資本金の額：279,928百万円（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 (2024年3月末現在)	事業の内容
----	-----------------------	-------

株式会社三菱ＵＦＪ銀行	1,711,958	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社武蔵野銀行	45,743	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社琉球銀行	56,967	百万円	銀行業務を営んでいます。
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。
アイザワ証券株式会社	3,000	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。
八十二証券株式会社	3,000	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。
いちよし証券株式会社	14,577	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。
ぐんぎん証券株式会社	3,000	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。
岩井コスモ証券株式会社	13,500	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。
新大垣証券株式会社	175	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。
大和証券株式会社	100,000	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。
南都まほろば証券株式会社	3,000	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。
野村證券株式会社	10,000	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。
ひろぎん証券株式会社	5,000	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。
三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500	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。
信金中央金庫	890,998	百万円	金融業務を営んでいます。
ほくほくＴＴ証券株式会社	1,250	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。

信金中央金庫の資本金の額は「出資金」を記載しております。

（３）再委託先

名称：モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・リミテッド

資本金の額：1,000,003米ドル（2023年12月末現在）

事業の内容：金融商品取引法に定める投資運用業務を営んでいます。

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8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10月30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」に掲げられているモルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン（為替ヘッジあり）予想分配金提示型の2024年2月27日から2024年8月23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、モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン（為替ヘッジあり）予想分配金提示型の2024年8月23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10月30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」に掲げられているモルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン（為替ヘッジなし）予想分配金提示型の2024年2月27日から2024年8月23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、モルガン・スタンレー グローバル・プレミアム株式オープン（為替ヘッジなし）予想分配金提示型の2024年8月23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。