

月次改訂

2008 / 10

### 三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)



追加型株式投資信託/バランス型

#### ファンドの特色

- ・日本を除く世界各国の公社債を実質的な主要投資対象とします。
- ・運用にあたっては、三菱UFJ 外国債券マザーファンドを通じて、日本を除く世界各国の公社債への投資を行います。なお、公社債、短期金融商品に直接投資することがあります。
- ・マザーファンドの組入比率は高位を維持することを基本とします。
- ・シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・原則として、組入れ国債等の利子・配当等収益を中心に分配を行う方針です。
- ・実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

#### 商品概要

設定日 : 2008年3月31日  
 決算日 : 原則として、毎年1月17日(休業日の場合は翌営業日)  
 信託期間 : 無期限  
 ベンチマーク : シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)  
 お買付け申込み・中途換金 : 原則として、いつでもお買付申込み、換金のお申込みができます。  
 申込価額 : 申込受付日の翌営業日の基準価額

**【お客さまには以下の費用をご負担いただきます。】**

申込時に直接ご負担いただく費用  
 申込手数料 : なし  
 換金時に直接ご負担いただく費用  
 信託財産留保額 : なし  
 保有期間中に間接的にご負担いただく費用  
 信託報酬 : 純資産総額に対して、年率 0.63% (税抜 0.6%)  
 その他費用(\*) : 売買委託手数料、監査報酬、組入資産の保管等に要する諸費用、先物取引・オプション取引等に要する費用等  
 (\*)「その他費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。  
 なお、お客さまにご負担いただく費用等の合計額については、お申込金額や保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。  
 (課税関係) 原則として、分配時の普通分配金ならびに換金(解約)時および償還時の個別元本超過額に対して課税されます。  
 詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

#### 当資料のご利用にあたっての注意事項等

当ファンドは、主に公社債を実質的な投資対象としますので、金利変動により組入公社債の価格が下落すること、組入公社債の発行者の倒産や財務状況の悪化等の影響により組入公社債の価格が下落すること等で当ファンドの基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、実質的に外貨建資産に投資しますので、為替の変動により損失を被ることがあります。したがって、投資家のみなさまの投資元金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、投資元金を割り込むことがあります。当ファンドの主な投資リスクとして、組入公社債の価格変動リスクや為替変動リスク、信用リスク、流動性リスク等があります。

詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 3 投資リスク」をご覧ください。

投資信託は、預金等や保険契約とは異なり、預金保険機構、貯金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。/ 金融商品取引業者以外の金融機関は、投資者保護基金に加入していません。/ 投資信託は、販売会社がお申込みの取扱いを行い委託会社が運用を行います。/ 投資信託の取得のお申込みを行う場合は、販売会社よりお渡しする最新の投資信託説明書(交付目論見書)の内容を必ずご確認ください。/ 投資信託は、書面による契約の解除(クーリング・オフ)の適用はありません。/ 運用により信託財産に生じた損益はすべて投資家のみなさまに帰属します。

当資料は、当ファンドの運用状況をお知らせするために三菱UFJ投信が作成した資料であり、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。/ 当資料の内容は作成時点のものであり、将来予告なく変更されることがあります。/ 当資料は信頼できると判断した情報等に基づき作成しておりますが、その正確性・完全性を保証するものではありません。/ 当資料中のグラフ・数値等は、過去の実績・状況であり、将来の市場環境等や運用成果等を示唆・保証するものではありません。また税金・手数料等を考慮していませんので、実質的な投資成果を示すものではありません。

市況動向および資金動向等により、ファンドの基本方針通りの運用が行えない場合があります。

#### (お申込みの際には、必ず投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。)

設定・運用 ...三菱UFJ投信株式会社  
 金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第404号  
 加入協会 (社)投資信託協会 / (社)日本証券投資顧問業協会  
 <お客様専用フリーダイヤル> 0120-151034 (毎営業日の9:00 ~ 17:00)  
 <オフィシャルサイト> <http://www.am.mufig.jp/>  
 基準価額・分配金をメール配信 <http://k.m-muam.jp/a/1/3>  
 (\*メール配信対象外ファンドもあります。)

**三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)**
**当ファンドにかかるリスクについて**

当ファンドへの投資にあたっては、主に以下のリスクを伴います。このため、お申込みの際は、当ファンドのリスクを認識・検討し、慎重に投資のご判断を行っていただく必要があります。

|               |  |
|---------------|--|
| <b>市場リスク</b>  | <p>(価格変動リスク)<br/>当ファンドは、公社債を実質的な主要投資対象とし、シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動する投資成果をめざしていることから、公社債の投資に係る価格変動リスクを伴います。一般に、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動するため、当ファンドはその影響を受け公社債の価格・シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)が下落した場合には基準価額の下落により損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。</p> <p>(為替変動リスク)<br/>実質的な主要投資対象である海外の公社債は外貨建資産ですので、為替変動の影響を受けます。そのため、為替相場が円高方向に進んだ場合には、基準価額の下落により損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。</p>  |
| <b>信用リスク</b>  | <p>信用リスクとは、有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等に、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払いや償還金の支払いが滞る等の債務が不履行となること等をいいます。当ファンドは、信用リスクを伴い、その影響を受けますので、基準価額の下落により損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。</p>   |
| <b>流動性リスク</b> | <p>有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない、または取引が不可能となるリスクのことを流動性リスクといい、当ファンドはそのリスクを伴います。例えば、組み入れている公社債の売却を十分な流動性の下で行えないときは、市場実勢から期待される価格で売却できない可能性があります。この場合、基準価額の下落により損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。</p>  |
| <b>留意事項</b>   | <ul style="list-style-type: none"> <li>・当ファンドは、一定の運用成果を保証するものではありません。</li> <li>・当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。</li> <li>・当ファンドはシティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)の動きに連動することをめざして運用を行います。信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、債券先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因によりカイ離を生じることがあります。</li> </ul> |

表紙の「当資料のご利用にあたっての注意事項等」をご覧ください。

月次改訂

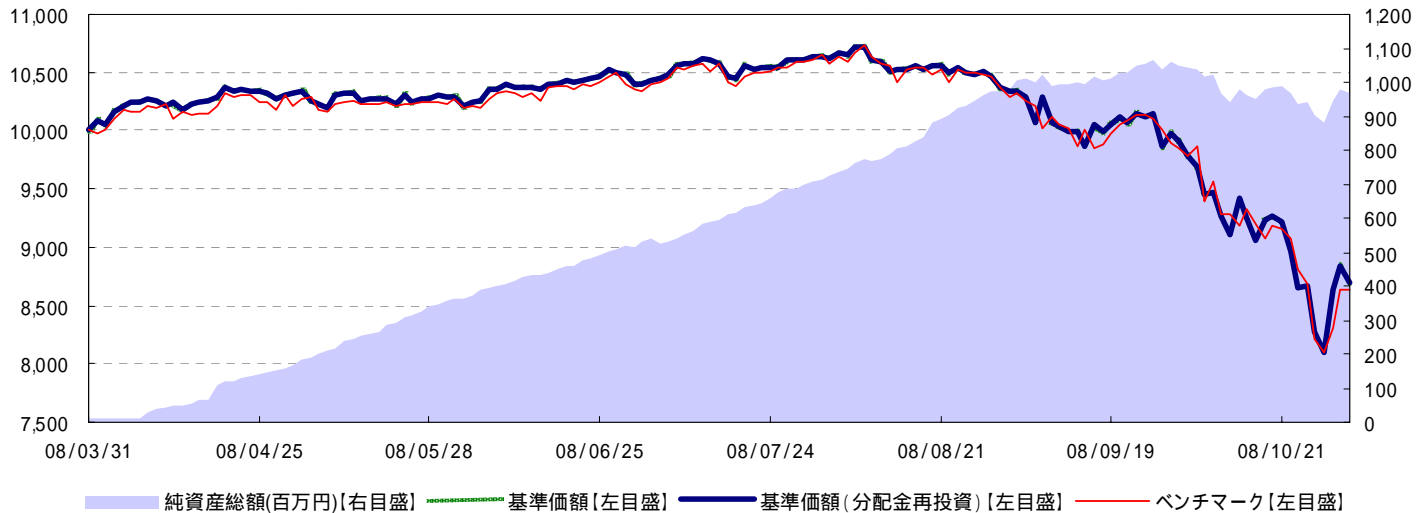
2008 / 10

## 三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)

追加型株式投資信託/バランス型

### 運用状況等

#### 基準価額の推移



- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)、ベンチマークは設定日前営業日を10,000として指数化しています。
- ・基準価額および基準価額(分配金再投資)は、信託報酬(純資産総額に対し、年率0.63%(税抜0.6%))控除後の値です。
- ・基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しています。

ベンチマークはシティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。  
 シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)とは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し指数化した債券インデックスです。

#### ファンドの現況

#### 運用資産構成

|            | 2008/10/31 | 前月末    | 前月末比    |
|------------|------------|--------|---------|
| 基準価額       | 8,694円     | 9,867円 | -1,173円 |
| 純資産総額(百万円) | 969        | 1,039  | -70     |

|            | 2008/10/31 | 前月末    | 前月末比   |
|------------|------------|--------|--------|
| 実質外国債券組入比率 | 99.31%     | 99.71% | -0.40% |
| 内 現物       | 99.31%     | 99.71% | -0.40% |
| 内 先物       | 0.00%      | 0.00%  | 0.00%  |

|       | 基準価額    | 日付         |
|-------|---------|------------|
| 設定来高値 | 10,722円 | 2008/08/07 |
| 設定来安値 | 8,102円  | 2008/10/28 |

・比率は純資産総額に対する割合です。

#### 騰落率

|        | 過去1ヵ月   | 過去3ヵ月   | 過去6ヵ月   | 過去1年 | 過去3年 | 設定来     |
|--------|---------|---------|---------|------|------|---------|
| ファンド   | -11.89% | -18.22% | -15.38% | -    | -    | -13.06% |
| ベンチマーク | -13.76% | -18.63% | -15.22% | -    | -    | -13.72% |
| 差      | 1.87%   | 0.41%   | -0.15%  | -    | -    | 0.66%   |

- ・ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。また、ファンドの騰落率と実際の投資者利回りとは異なります。
- ・設定来のファンドの騰落率は、10,000を起点として計算しています。

表示桁未満の数値がある場合、四捨五入で処理しております。  
 基準価額および分配金は1万口当たりです。  
 債券評価額には、経過利子を含めて(利含み)あります。

表紙の「当資料のご利用にあたっての注意事項等」をご覧ください。

## 三菱UFJ世界国債インデックスファンド(年1回決算型)

### 分配金実績(税引前)

|     | 直近期 | 2期前 | 3期前 | 4期前 | 5期前 | 6期前 | 設定来累計 |
|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-------|
| 決算日 | -   | -   | -   | -   | -   | -   | -     |
| 分配金 | -   | -   | -   | -   | -   | -   | -     |

・運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

### 利回り・デュレーション・平均残存期間

|       |       |         |       |
|-------|-------|---------|-------|
| 最終利回り | 3.53% | デュレーション | 5.85年 |
| 直接利回り | 4.45% | 平均残存年数  | 8.42年 |

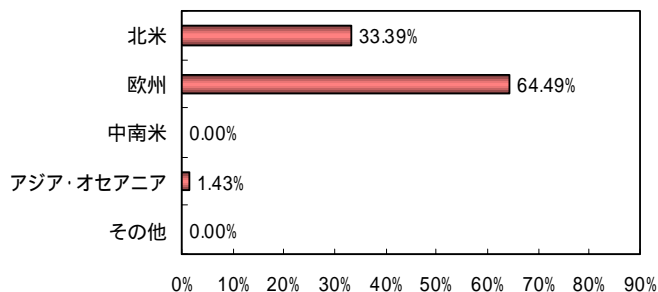
- ・数値は、債券現物部分について計算しています。
- ・最終利回りとは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。
- ・直接利回りとは、個別債券等についての表面利率を加重平均したものです。
- ・利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。
- ・デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。
- ・平均残存年数は、各債券の残存年数を債券の額面で加重平均したものです。

### 債券の格付分布

| 格付種類  | 比率     | 銘柄数 |
|-------|--------|-----|
| AAA格  | 81.82% | 349 |
| AA格   | 15.93% | 61  |
| A格    | 1.57%  | 15  |
| BBB格  | 0.00%  | 0   |
| BB格以下 | 0.00%  | 0   |
| 無格付   | 0.00%  | 0   |

- ・比率は純資産総額に対する割合です。
- ・格付の振分基準は以下の通りです。
  - ・AA格(AA+, AA-, Aa1, Aa2, Aa3)
  - ・A格(A+, A-, A1, A2, A3)
  - ・BBB格(BBB+, BBB-, Baa1, Baa2, Baa3)
  - ・BB格(BB+, BB-, Ba1, Ba2, Ba3)
- ・原則として、個別銘柄格付を採用しておりますが、例外的に国債、地方債ならびに政府保証のある債券などについては、弊社の分類基準に基づいて、ソブリン格付(国の発行体格付)を採用しているものがあります。
- ・格付分布は、R&I社、JCR社、S&P社、Moody's社のうち最も高い格付を表示しています。

### 投資地域別組入比率



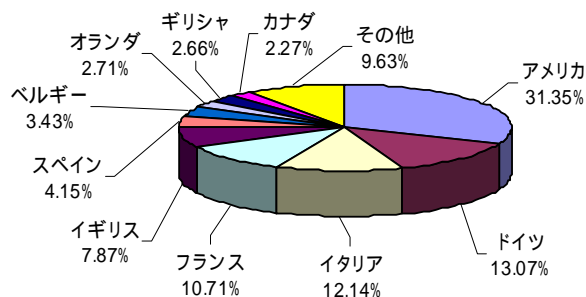
・比率は純資産総額に対する割合です。

表示桁未満の数値がある場合、四捨五入で処理しております。  
 基準価額および分配金は1万円当たりです。  
 債券評価額には、経過利子を含めて(利含み)あります。

表紙の「当資料のご利用にあたっての注意事項等」をご覧ください。

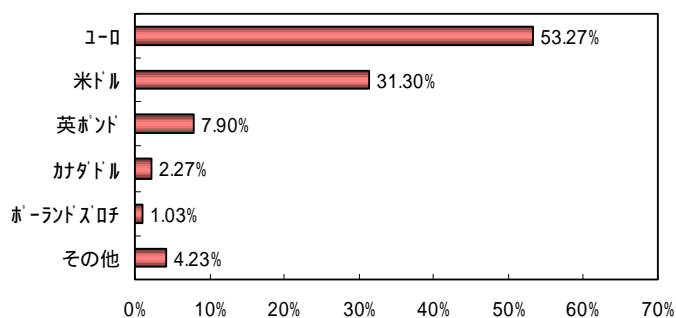
三菱UFJ世界国債インデックスファンド(年1回決算型)

組入上位10カ国



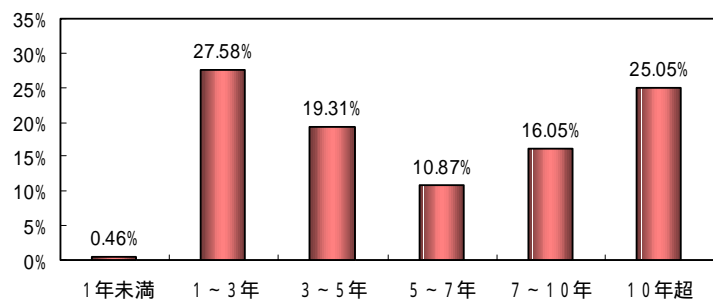
・比率は現物債券評価額に対する割合です。

通貨別組入比率



・比率は、[外貨建て純資産 - 為替ヘッジ]で計算しており、通貨別にみた実質比率を表します。

残存期間別組入比率



・比率は純資産総額に対する割合です。

表示桁未満の数値がある場合、四捨五入で処理しております。  
 基準価額および分配金は1万口当たりです。  
 債券評価額には、経過利子を含めて(利含み)あります。

表紙の「当資料のご利用にあたっての注意事項等」をご覧ください。

