

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券	
信託期間	無期限（2004年8月23日設定）	
運用方針	ファミリーファンド方式により、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	ベビーファンド	ワールド短期ソブリンオープンマザーファンド受益証券
	マザーファンド	日本を除く世界主要先進国のソブリン債券（国債、政府機関債等）
運用方法	・日本を除く世界主要先進国のソブリン債券を主要投資対象とし、分散投資を行います。 ・ソブリン債券からの利子収入に加え、デュレーションを原則として1～3年程度の範囲とすることで、安定した投資成果を目指します。	
主な組入制限	ベビーファンド	・マザーファンドへの投資は、制限を設けません。 ・外貨建資産への実質投資は、制限を設けません。 ・残存期間が5年を超える債券には、原則として投資を行いません。 ・残存期間が3年を超える債券への実質投資割合は、取得時において、当ファンドの純資産総額の20%以内とします。
	マザーファンド	・外貨建資産への投資は、制限を設けません。 ・残存期間が5年を超える債券には、原則として投資を行いません。 ・残存期間が3年を超える債券への投資割合は、取得時において、当マザーファンドの純資産総額の20%以内とします。
分配方針	毎月10日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、収益分配方針に基づいて分配を行います。分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。基準価額の水準、市況動向、利子・配当収益の水準等を勘案して分配金額を決定します。原則として、配当等収益や分配対象額の水準等を考慮し、安定した分配を継続することをめざします。基準価額水準、運用状況等によっては安定した分配とならないことがあります。	

運用報告書（全体版）

ワールド短期ソブリンオープン



第257期（決算日：2026年3月10日）
第258期（決算日：2026年4月10日）
第259期（決算日：2026年5月11日）
第260期（決算日：2026年6月10日）
第261期（決算日：2026年7月10日）
第262期（決算日：2026年8月10日）



受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
ここに謹んで運用経過等をご報告申し上げます。
今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。



三菱UFJアセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9番1号
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客さま専用 フリーダイヤル	0120-151034
	（受付時間：営業日の9:00～17:00、 土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）
お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。	

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近30期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			F T S E 世界国債 インデックス1－3年 (除く日本、円ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 配	み 期 中 金 騰 落 率	期 中 騰 落 率				
	円	円	%		%	%	%	百万円
233期(2024年3月11日)	7,724	5	△1.1	340.29	△0.8	97.1	—	4,236
234期(2024年4月10日)	7,949	5	3.0	349.53	2.7	97.1	—	4,351
235期(2024年5月10日)	8,132	5	2.4	358.27	2.5	97.1	—	4,416
236期(2024年6月10日)	8,191	5	0.8	362.11	1.1	94.7	—	4,427
237期(2024年7月10日)	8,495	5	3.8	375.15	3.6	94.6	—	4,581
238期(2024年8月13日)	7,835	5	△7.7	349.00	△7.0	96.1	—	4,201
239期(2024年9月10日)	7,709	5	△1.5	340.73	△2.4	97.2	—	4,115
240期(2024年10月10日)	7,973	5	3.5	355.22	4.3	97.6	—	4,244
241期(2024年11月11日)	8,086	5	1.5	360.56	1.5	97.1	—	4,274
242期(2024年12月10日)	8,005	5	△0.9	357.03	△1.0	98.0	—	4,194
243期(2025年1月10日)	8,266	5	3.3	370.03	3.6	97.7	—	4,298
244期(2025年2月10日)	7,984	5	△3.4	356.72	△3.6	97.1	—	4,140
245期(2025年3月10日)	7,872	5	△1.3	353.79	△0.8	98.0	—	4,064
246期(2025年4月10日)	7,881	5	0.2	349.64	△1.2	96.4	—	4,045
247期(2025年5月12日)	7,942	5	0.8	354.80	1.5	97.3	—	4,047
248期(2025年6月10日)	7,917	5	△0.3	356.02	0.3	97.5	—	4,025
249期(2025年7月10日)	8,077	5	2.1	364.60	2.4	98.0	—	4,079
250期(2025年8月12日)	8,187	5	1.4	368.64	1.1	97.2	—	4,109
251期(2025年9月10日)	8,195	5	0.2	369.57	0.3	97.6	—	4,083
252期(2025年10月10日)	8,475	5	3.5	383.63	3.8	96.2	—	4,191
253期(2025年11月10日)	8,529	5	0.7	384.80	0.3	96.0	—	4,190
254期(2025年12月10日)	8,728	5	2.4	395.97	2.9	96.1	—	4,265
255期(2026年1月13日)	8,878	5	1.8	401.75	1.5	97.9	—	4,306
256期(2026年2月10日)	8,899	5	0.3	400.69	△0.3	97.3	—	4,279
257期(2026年3月10日)	8,899	5	0.1	403.36	0.7	94.0	—	4,264
258期(2026年4月10日)	8,985	5	1.0	407.38	1.0	95.9	—	4,269
259期(2026年5月11日)	8,901	5	△0.9	403.04	△1.1	98.6	—	4,232
260期(2026年6月10日)	9,025	5	1.4	410.37	1.8	97.6	—	4,226
261期(2026年7月10日)	9,091	5	0.8	415.28	1.2	96.4	—	4,228
262期(2026年8月10日)	8,964	5	△1.3	406.77	△2.0	97.6	—	4,137

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) F T S E 世界国債インデックス1－3年(除く日本、円ベース)をベンチマークとします。

F T S E 世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世 界 国 債 インデックス1ー3年 (除く日本、円ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
			騰 落 率		騰 落 率		
第257期	(期 首) 2026年2月10日	円 8,899	% —	400.69	% —	% 97.3	% —
	2月末	8,891	△0.1	401.55	0.2	98.0	—
	(期 末) 2026年3月10日	8,904	0.1	403.36	0.7	94.0	—
第258期	(期 首) 2026年3月10日	8,899	—	403.36	—	94.0	—
	3月末	8,937	0.4	404.38	0.3	95.9	—
	(期 末) 2026年4月10日	8,990	1.0	407.38	1.0	95.9	—
第259期	(期 首) 2026年4月10日	8,985	—	407.38	—	95.9	—
	4月末	9,045	0.7	410.04	0.7	98.1	—
	(期 末) 2026年5月11日	8,906	△0.9	403.04	△1.1	98.6	—
第260期	(期 首) 2026年5月11日	8,901	—	403.04	—	98.6	—
	5月末	9,018	1.3	408.90	1.5	97.6	—
	(期 末) 2026年6月10日	9,030	1.4	410.37	1.8	97.6	—
第261期	(期 首) 2026年6月10日	9,025	—	410.37	—	97.6	—
	6月末	9,094	0.8	413.99	0.9	95.9	—
	(期 末) 2026年7月10日	9,096	0.8	415.28	1.2	96.4	—
第262期	(期 首) 2026年7月10日	9,091	—	415.28	—	96.4	—
	7月末	9,081	△0.1	409.00	△1.5	96.7	—
	(期 末) 2026年8月10日	8,969	△1.3	406.77	△2.0	97.6	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

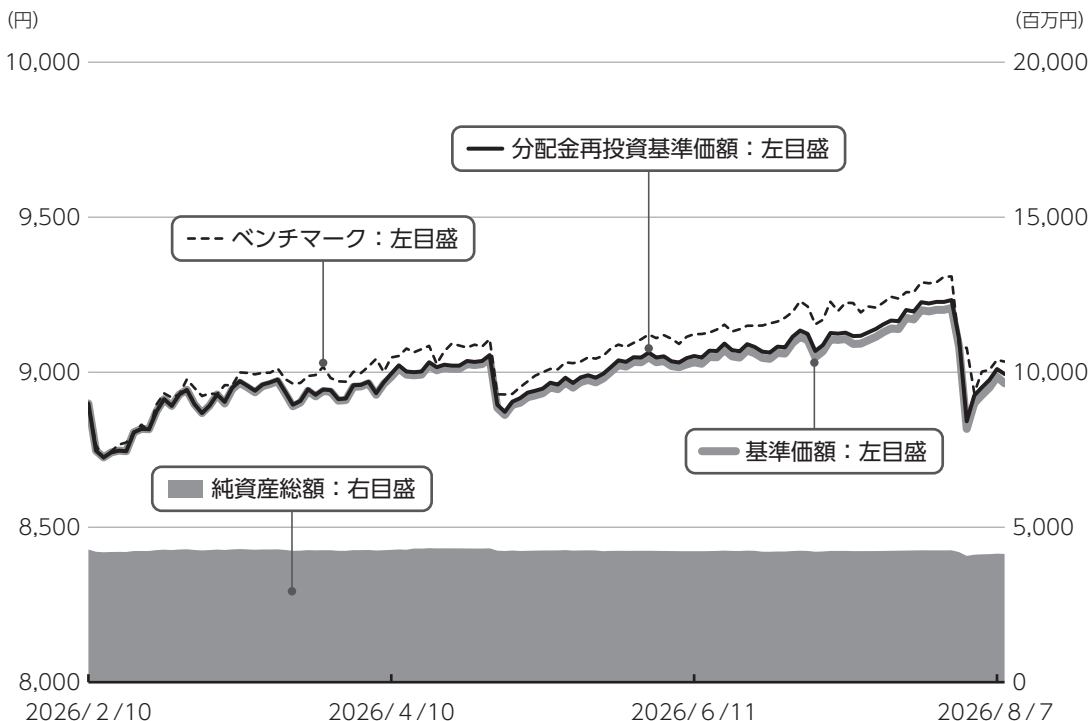
(注) 「債券先物比率」は買建比率ー売建比率。

運用経過

第257期～第262期：2026年2月11日～2026年8月10日

▶ 当作成期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第257期首	8,899円
第262期末	8,964円
既払分配金	30円
騰落率	1.1%

(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ1.1%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（1.5%）を0.4%下回りました。

> 基準価額の主な変動要因

上昇要因

米ドルや中国元が対円で上昇したことや債券利子収益を享受したことなどが基準価額の上昇要因となりました。

第257期～第262期：2026年2月11日～2026年8月10日

投資環境について

▶ 債券市況

米国・ドイツ・英国の2年債利回りは上昇しました。

米国・ドイツ・英国の2年債利回りは、米国とイスラエルによるイラン攻撃を受けた原油価格上昇を背景に、インフレ懸念や利上げ観測が高まったことなどから上昇しました。

▶ 為替市況

米ドルは対円で上昇、ユーロ・英ポンドは対円で下落しました。

米ドル・ユーロ・英ポンドは、前記利上げ観測の高まりなどが対円での上昇要因となった一方、期間中に複数の米ドル売り・円買いの介入が実施されたことを受けて円高が進行したことなどが対円での下落要因となりました。結果、期間を通じてみると、米ドルは対円で上昇、ユーロ・英ポンドは対円で下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ ワールド短期ソブリンオープン

当ファンドは、運用の基本方針に基づき、ワールド短期ソブリンオープン マザーファンド受益証券を通じて、日本を除く世界主要先進国のソブリン債券を主要投資対象とするとともにデュレーションを原則として1～3年程度の範囲とすることで、安定した投資成果を目指す運用を行いました。

期間を通じて外貨組入比率を高水準に保ち、外貨建資産については為替ヘッジを行いませんでした。

▶ ワールド短期ソブリンオープン マザーファンド

日本を除く世界主要先進国のソブリン債券（国債、政府機関債等をいいます。）を主要投資対象とし、期間を通じて債券の組入比率は高位を維持しました。

通貨戦略（国別配分）

相対的な景況感や投資家のリスクセンチメントなどから、期間を通じて豪ドルやメキシコペソをベンチマーク比概ね多めとし、ユーロや英ポンドを概ね少なめとしました。また、ニュージーランドドルやスウェーデンクローネ、ノルウェークローネやポーランドズロチ、韓国ウォンを中立から多めでコントロールしつつ、

米ドルは機動的に操作しました。

債券戦略

デュレーションは、主要国のインフレ動向や金融政策の織り込みなどを注視し、ベンチマーク比中立で維持しました。

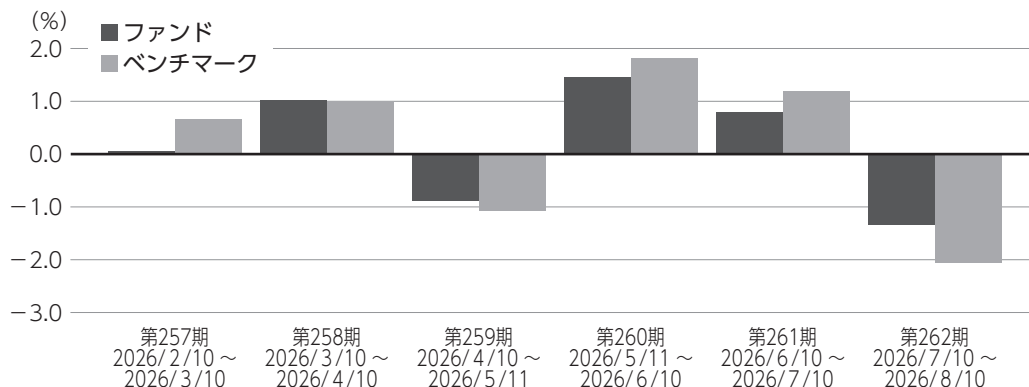
※デュレーションとは、「金利変動に対する債券価格の変動性」を示すもので、債券はデュレーションが大きいほど、金利変動に対する価格の変動が大きくなる傾向があります。

期間を通じて外貨組入比率を高水準に保ち、外貨建資産については為替ヘッジを行いませんでした。

第257期～第262期：2026/2/11～2026/8/10

当該投資信託のベンチマークとの差異について

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



※ファンドの騰落率は分配金込みで計算しています。

ワールド短期ソブリンオープン

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（1.5%）を0.4%下回りました。

マザーファンド保有以外の要因

信託報酬などの運用管理費用がマイナスに影響しました。

マザーファンド保有による要因

(プラス要因)

2026年7月にベンチマーク比で韓国ウォンやノルウェークローネ、豪ドルを多め、米ドルを少なめとしていたことなどがプラス要因となりました。

分配金について

収益分配金につきましては、基準価額の水準、市況動向、利子・配当収益の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第257期 2026年2月11日～ 2026年3月10日	第258期 2026年3月11日～ 2026年4月10日	第259期 2026年4月11日～ 2026年5月11日	第260期 2026年5月12日～ 2026年6月10日	第261期 2026年6月11日～ 2026年7月10日	第262期 2026年7月11日～ 2026年8月10日
当期分配金 (対基準価額比率)	5 (0.056%)	5 (0.056%)	5 (0.056%)	5 (0.055%)	5 (0.055%)	5 (0.056%)
当期の収益	5	5	5	5	5	5
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	825	905	915	945	1,011	1,021

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針 （作成対象期間末での見解です。）

▶ ワールド短期ソブリンオープン

ワールド短期ソブリンオープン マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保ち、運用を行っていく方針です。

▶ ワールド短期ソブリンオープン マザーファンド

通貨戦略（国別配分）では、景気の相対感などに着目し、ベンチマーク比でメキシコペソや中国元、豪ドルなどを多め、米ドルやユーロなどを少なめとする方針です。

債券戦略では、米国では当面政策金利を据え置く一方、欧州など一部の地域では政策金利は徐々に引き上げられるとの見通しの下、今後の金融政策の織り込みを注視しながら、デュレーションは機動的に操作する方針です。

2026年2月11日～2026年8月10日

1 万口当たりの費用明細

項目	第257期～第262期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a)信 託 報 酬	39	0.436	(a)信託報酬＝作成期中の平均基準価額×信託報酬率×（作成期中の日数÷年間日数）
（ 投 信 会 社 ）	(20)	(0.218)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
（ 販 売 会 社 ）	(17)	(0.191)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（ 受 託 会 社 ）	(2)	(0.027)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b)そ の 他 費 用	3	0.028	(b)その他費用＝作成期中のその他費用÷作成期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(2)	(0.026)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	42	0.464	

作成期中の平均基準価額は、8,988円です。

(注) 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

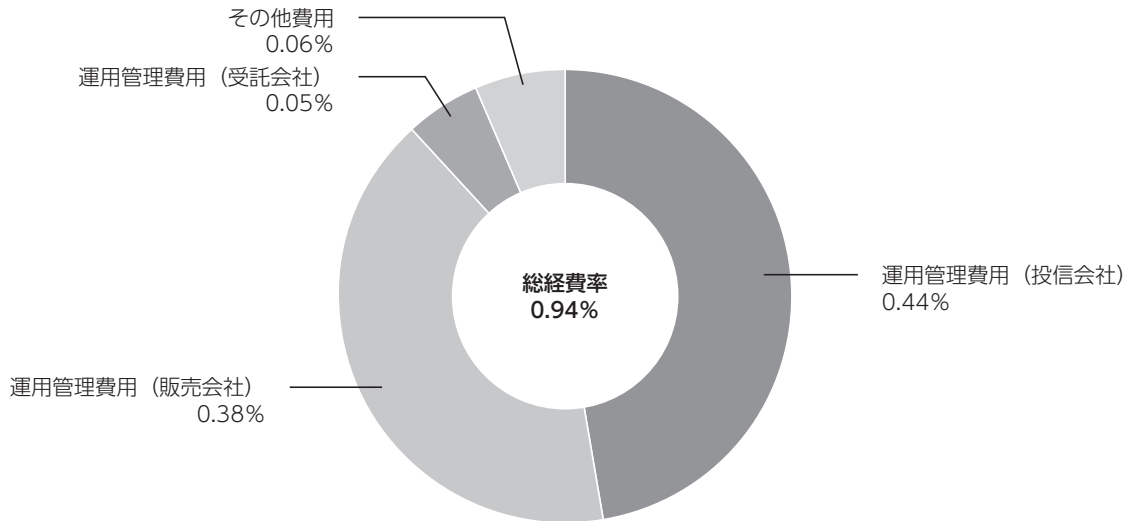
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

■総経費率

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.94%**です。



(注) 費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2026年2月11日～2026年8月10日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘	柄	第257期～第262期			
		設 定		解 約	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
ワールド短期ソブリンオープン	マザーファンド	22,051	50,666	111,571	256,694

○利害関係人との取引状況等

(2026年2月11日～2026年8月10日)

利害関係人との取引状況

<ワールド短期ソブリンオープン>

該当事項はございません。

<ワールド短期ソブリンオープン マザーファンド>

区 分	第257期～第262期					
	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 3,027	百万円 87	% 2.9	百万円 3,250	百万円 68	% 2.1

平均保有割合 100.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2026年8月10日現在)

親投資信託残高

銘	柄	第256期末	第262期末	
		口 数	口 数	評 価 額
		千口	千口	千円
ワールド短期ソブリンオープン	マザーファンド	1,878,631	1,789,111	4,122,648

○投資信託財産の構成

(2026年 8 月10日現在)

項 目	第262期末	
	評 価 額	比 率
ワールド短期ソブリンオープン マザーファンド	千円 4, 122, 648	% 99. 5
コール・ローン等、その他	20, 413	0. 5
投資信託財産総額	4, 143, 061	100. 0

(注) ワールド短期ソブリンオープン マザーファンドにおいて、作成期末における外貨建純資産 (4, 113, 175千円) の投資信託財産総額 (4, 178, 379千円) に対する比率は98. 4%です。

(注) 外貨建資産は、作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、作成期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=157. 98円	1 カナダドル=113. 26円	1 メキシコペソ=9. 2173円	1 ユーロ=182. 59円
1 イギリスポンド=213. 15円	1 スウェーデンクローネ=16. 65円	1 ノルウェークローネ=16. 63円	1 ボーランドズロチ=42. 4679円
1 オーストラリアドル=111. 61円	1 ニュージーランドドル=92. 96円	1 シンガポールドル=123. 53円	100韓国ウォン=11. 1736円
1 中国元=23. 4085円	1 イスラエルシェケル=52. 6317円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第257期末	第258期末	第259期末	第260期末	第261期末	第262期末
	2026年 3 月10日現在	2026年 4 月10日現在	2026年 5 月11日現在	2026年 6 月10日現在	2026年 7 月10日現在	2026年 8 月10日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	4, 270, 941, 924	4, 281, 028, 816	4, 256, 523, 041	4, 233, 572, 733	4, 233, 902, 061	4, 143, 061, 685
コール・ローン等	19, 490, 032	20, 144, 213	20, 236, 462	19, 880, 967	19, 844, 625	19, 495, 709
ワールド短期ソブリンオープン マザーファンド(詳細欄)	4, 249, 626, 022	4, 253, 994, 437	4, 217, 606, 372	4, 211, 181, 858	4, 213, 189, 574	4, 122, 648, 751
未収入金	1, 825, 486	6, 889, 769	18, 679, 808	2, 509, 516	867, 335	916, 707
未収利息	384	397	399	392	527	518
(B) 負債	6, 098, 344	11, 898, 687	23, 864, 471	7, 397, 864	5, 694, 301	5, 677, 014
未払収益分配金	2, 396, 176	2, 375, 571	2, 377, 558	2, 341, 316	2, 325, 390	2, 307, 896
未払解約金	823, 312	6, 319, 062	18, 268, 164	1, 973, 334	296, 754	205, 401
未払信託報酬	2, 864, 541	3, 188, 122	3, 202, 744	3, 067, 884	3, 056, 883	3, 147, 988
その他未払費用	14, 315	15, 932	16, 005	15, 330	15, 274	15, 729
(C) 純資産総額 (A－B)	4, 264, 843, 580	4, 269, 130, 129	4, 232, 658, 570	4, 226, 174, 869	4, 228, 207, 760	4, 137, 384, 671
元本	4, 792, 353, 011	4, 751, 142, 527	4, 755, 117, 277	4, 682, 632, 851	4, 650, 781, 550	4, 615, 792, 075
次期繰越損益金	△ 527, 509, 431	△ 482, 012, 398	△ 522, 458, 707	△ 456, 457, 982	△ 422, 573, 790	△ 478, 407, 404
(D) 受益権総口数	4, 792, 353, 011口	4, 751, 142, 527口	4, 755, 117, 277口	4, 682, 632, 851口	4, 650, 781, 550口	4, 615, 792, 075口
1 万口当たり基準価額 (C／D)	8, 899円	8, 985円	8, 901円	9, 025円	9, 091円	8, 964円

○損益の状況

項 目	第257期	第258期	第259期	第260期	第261期	第262期
	2026年2月11日～ 2026年3月10日	2026年3月11日～ 2026年4月10日	2026年4月11日～ 2026年5月11日	2026年5月12日～ 2026年6月10日	2026年6月11日～ 2026年7月10日	2026年7月11日～ 2026年8月10日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	7,982	8,949	9,180	8,462	10,882	12,319
受取利息	7,982	8,949	9,180	8,462	10,882	12,319
(B) 有価証券売買損益	5,599,730	46,522,215	△ 34,482,658	63,437,277	36,156,172	△ 53,490,230
売買益	6,312,380	46,682,047	237,454	64,211,447	36,463,319	313,660
売買損	△ 712,650	△ 159,832	△ 34,720,112	△ 774,170	△ 307,147	△ 53,803,890
(C) 信託報酬等	△ 2,878,856	△ 3,204,054	△ 3,218,749	△ 3,083,214	△ 3,072,157	△ 3,163,717
(D) 当期損益金 (A + B + C)	2,728,856	43,327,110	△ 37,692,227	60,362,525	33,094,897	△ 56,641,628
(E) 前期繰越損益金	363,482,733	360,452,574	397,837,870	352,134,678	407,127,162	434,086,356
(F) 追加信託差損益金	△891,324,844	△883,416,511	△880,226,792	△866,613,869	△860,470,459	△853,544,236
(配当等相当額)	(28,680,502)	(28,673,005)	(32,602,525)	(32,373,521)	(32,394,840)	(32,670,205)
(売買損益相当額)	(△920,005,346)	(△912,089,516)	(△912,829,317)	(△898,987,390)	(△892,865,299)	(△886,214,441)
(G) 計 (D + E + F)	△525,113,255	△479,636,827	△520,081,149	△454,116,666	△420,248,400	△476,099,508
(H) 収益分配金	△ 2,396,176	△ 2,375,571	△ 2,377,558	△ 2,341,316	△ 2,325,390	△ 2,307,896
次期繰越損益金 (G + H)	△527,509,431	△482,012,398	△522,458,707	△456,457,982	△422,573,790	△478,407,404
追加信託差損益金	△891,324,844	△883,416,511	△880,226,792	△866,613,869	△860,470,459	△853,544,236
(配当等相当額)	(28,683,337)	(28,676,681)	(32,669,170)	(32,376,246)	(32,398,041)	(32,676,051)
(売買損益相当額)	(△920,008,181)	(△912,093,192)	(△912,895,962)	(△898,990,115)	(△892,868,500)	(△886,220,287)
分配準備積立金	366,932,064	401,404,113	402,530,051	410,155,887	437,896,669	439,009,104
繰越損益金	△ 3,116,651	—	△ 44,761,966	—	—	△ 63,872,272

(注) (B) 有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

- ①作成期首（前作成期末）元本額 4,809,253,514円
作成期中追加設定元本額 63,125,081円
作成期中一部解約元本額 256,586,520円
また、1口当たり純資産額は、作成期末0.8964円です。
- ②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は478,407,404円です。
- ③分配金の計算過程

項 目	2026年2月11日～ 2026年3月10日	2026年3月11日～ 2026年4月10日	2026年4月11日～ 2026年5月11日	2026年5月12日～ 2026年6月10日	2026年6月11日～ 2026年7月10日	2026年7月11日～ 2026年8月10日
費用控除後の配当等収益額	5,845,507円	8,928,586円	7,069,739円	8,965,946円	8,827,632円	7,230,644円
費用控除後・繰越欠損金繰戻後の有価証券売買等損益額	—円	31,310,680円	—円	7,339,433円	24,267,265円	—円
収益調整金額	28,683,337円	28,676,681円	32,669,170円	32,376,246円	32,398,041円	32,676,051円
分配準備積立金額	363,482,733円	363,540,418円	397,837,870円	396,191,824円	407,127,162円	434,086,356円
当ファンドの分配対象収益額	398,011,577円	432,456,365円	437,576,779円	444,873,449円	472,620,100円	473,993,051円
1万口当たり収益分配対象額	830円	910円	920円	950円	1,016円	1,026円
1万口当たり分配金額	5円	5円	5円	5円	5円	5円
収益分配金金額	2,396,176円	2,375,571円	2,377,558円	2,341,316円	2,325,390円	2,307,896円

○分配金のお知らせ

	第257期	第258期	第259期	第260期	第261期	第262期
1 万口当たり分配金（税込み）	5円	5円	5円	5円	5円	5円

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者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、その後の個々の受益者の個別元本となります。

*三菱ＵＦＪアセットマネジメントでは本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ（<https://www.am.mufg.jp/>）をご覧ください。

【お 知 ら せ】

投資信託約款に記載された「一般社団法人投資信託協会」を、「一般社団法人資産運用業協会」に記載変更を行いました。
一般社団法人資産運用業協会設立準備法人を吸収合併存続法人、一般社団法人日本投資顧問業協会と一般社団法人投資信託協会を吸収合併消滅法人として2026年4月1日付で合併し、「一般社団法人資産運用業協会」に名称を変更することとなったため、投資信託約款に所要の変更を行いました。
(2026年4月1日)

ワールド短期ソブリンオープン マザーファンド

《第257期》決算日2026年3月10日

《第260期》決算日2026年6月10日

《第258期》決算日2026年4月10日

《第261期》決算日2026年7月10日

《第259期》決算日2026年5月11日

《第262期》決算日2026年8月10日

 [計算期間：2026年2月11日～2026年8月10日]

「ワールド短期ソブリンオープン マザーファンド」は、8月10日に第262期の決算を行いました。
 以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第257期～第262期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主 要 運 用 対 象	日本を除く世界主要先進国のソブリン債券（国債、政府機関債等）
主 な 組 入 制 限	・ 外貨建資産への投資は、制限を設けません。 ・ 残存期間が5年を超える債券には、原則として投資を行いません。 ・ 残存期間が3年を超える債券への投資割合は、取得時において、当マザーファンドの純資産総額の20%以内とします。

○最近30期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		F T S E 世 界 国 債 インデックス 1 - 3 年 (除く日本、円ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
233期(2024年3月11日)	19,089	△1.0	340.29	△0.8	97.5	—	4,220
234期(2024年4月10日)	19,674	3.1	349.53	2.7	97.4	—	4,335
235期(2024年5月10日)	20,154	2.4	358.27	2.5	97.5	—	4,400
236期(2024年6月10日)	20,329	0.9	362.11	1.1	95.0	—	4,412
237期(2024年7月10日)	21,114	3.9	375.15	3.6	95.0	—	4,565
238期(2024年8月13日)	19,498	△7.7	349.00	△7.0	96.4	—	4,186
239期(2024年9月10日)	19,208	△1.5	340.73	△2.4	97.6	—	4,100
240期(2024年10月10日)	19,896	3.6	355.22	4.3	98.0	—	4,229
241期(2024年11月11日)	20,206	1.6	360.56	1.5	97.5	—	4,258
242期(2024年12月10日)	20,030	△0.9	357.03	△1.0	98.4	—	4,179
243期(2025年1月10日)	20,713	3.4	370.03	3.6	98.1	—	4,283
244期(2025年2月10日)	20,032	△3.3	356.72	△3.6	97.4	—	4,125
245期(2025年3月10日)	19,777	△1.3	353.79	△0.8	98.4	—	4,049
246期(2025年4月10日)	19,826	0.2	349.64	△1.2	96.8	—	4,031
247期(2025年5月12日)	20,008	0.9	354.80	1.5	97.7	—	4,033
248期(2025年6月10日)	19,973	△0.2	356.02	0.3	97.8	—	4,011
249期(2025年7月10日)	20,405	2.2	364.60	2.4	98.4	—	4,064
250期(2025年8月12日)	20,713	1.5	368.64	1.1	97.6	—	4,094
251期(2025年9月10日)	20,762	0.2	369.57	0.3	98.0	—	4,068
252期(2025年10月10日)	21,500	3.6	383.63	3.8	96.5	—	4,176
253期(2025年11月10日)	21,668	0.8	384.80	0.3	96.4	—	4,175
254期(2025年12月10日)	22,203	2.5	395.97	2.9	96.5	—	4,250
255期(2026年1月13日)	22,618	1.9	401.75	1.5	98.3	—	4,291
256期(2026年2月10日)	22,699	0.4	400.69	△0.3	97.6	—	4,264
257期(2026年3月10日)	22,729	0.1	403.36	0.7	94.4	—	4,249
258期(2026年4月10日)	22,980	1.1	407.38	1.0	96.2	—	4,253
259期(2026年5月11日)	22,794	△0.8	403.04	△1.1	99.0	—	4,217
260期(2026年6月10日)	23,142	1.5	410.37	1.8	98.0	—	4,211
261期(2026年7月10日)	23,342	0.9	415.28	1.2	96.8	—	4,213
262期(2026年8月10日)	23,043	△1.3	406.77	△2.0	97.9	—	4,122

(注) F T S E 世界国債インデックス 1 - 3 年 (除く日本、円ベース) をベンチマークとします。

F T S E 世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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

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。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世 界 国 債 インデックス1ー3年 (除く日本、円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
			騰 落 率		騰 落 率		
第257期	(期 首) 2026年2月10日	円 22,699	% —	400.69	% —	% 97.6	% —
	2月末	22,688	△0.0	401.55	0.2	98.3	—
	(期 末) 2026年3月10日	22,729	0.1	403.36	0.7	94.4	—
第258期	(期 首) 2026年3月10日	22,729	—	403.36	—	94.4	—
	3月末	22,836	0.5	404.38	0.3	96.2	—
	(期 末) 2026年4月10日	22,980	1.1	407.38	1.0	96.2	—
第259期	(期 首) 2026年4月10日	22,980	—	407.38	—	96.2	—
	4月末	23,143	0.7	410.04	0.7	98.4	—
	(期 末) 2026年5月11日	22,794	△0.8	403.04	△1.1	99.0	—
第260期	(期 首) 2026年5月11日	22,794	—	403.04	—	99.0	—
	5月末	23,105	1.4	408.90	1.5	97.9	—
	(期 末) 2026年6月10日	23,142	1.5	410.37	1.8	98.0	—
第261期	(期 首) 2026年6月10日	23,142	—	410.37	—	98.0	—
	6月末	23,331	0.8	413.99	0.9	96.2	—
	(期 末) 2026年7月10日	23,342	0.9	415.28	1.2	96.8	—
第262期	(期 首) 2026年7月10日	23,342	—	415.28	—	96.8	—
	7月末	23,326	△0.1	409.00	△1.5	97.0	—
	(期 末) 2026年8月10日	23,043	△1.3	406.77	△2.0	97.9	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当作成期中の基準価額等の推移について

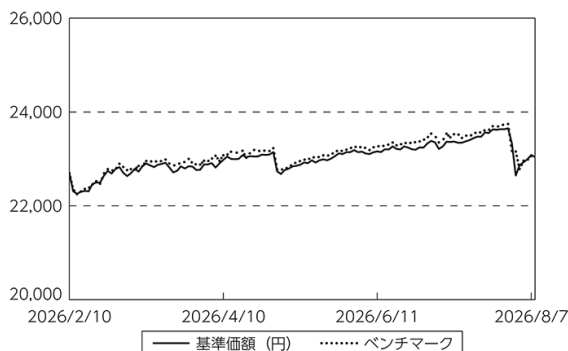
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ1.5%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(1.5%)と同程度となりました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは当作成期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

- ・米ドルや中国元が対円で上昇したことや債券利子収益を享受したことが基準価額の上昇要因となりました。

●投資環境について

◎債券市況

- ・米国・ドイツ・英国の2年債利回りは上昇しました。
- ・米国・ドイツ・英国の2年債利回りは、米国とイスラエルによるイラン攻撃を受けた原油価格上昇を背景に、インフレ懸念や利上げ観測が高まったことなどから上昇しました。

◎為替市況

- ・米ドルは対円で上昇、ユーロ・英ポンドは対円で下落しました。
- ・米ドル・ユーロ・英ポンドは、前記利上げ観測の高まりなどが対円での上昇要因となった一方、期間中に複数の米ドル売り・円買いの介入が実施されたことを受けて円高が進行したことなどが対円での下落要因となりました。結果、期間を通じてみると、米ドルは対円で上昇、ユーロ・英ポンドは対円で下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・日本を除く世界主要先進国のソブリン債券（国債、政府機関債等をいいます。）を主要投資対象とし、期間を通じて債券の組入比率は高位を維持しました。

◎通貨戦略（国別配分）

- ・相対的な景況感や投資家のリスクセンチメントなどから、期間を通じて豪ドルやメキシコペソをベンチマーク比概ね多めとし、ユーロや英ポンドを概ね少なめとしました。また、ニュージーランドドルやスウェーデンクローネ、ノルウェークローネやポーランドズロチ、韓国ウォンを中立から多めでコントロールしつつ、米ドルは機動的に操作しました。

◎債券戦略

- ・デュレーションは、主要国のインフレ動向や金融政策の織り込みなどを注視し、ベンチマーク比中立で維持しました。

※デュレーションとは、「金利変動に対する債券価格の変動性」を示すもので、債券はデュレーションが大きいほど、金利変動に対する価格の変動が大きくなる傾向があります。

- ・期間を通じて外貨組入比率を高水準に保ち、外貨建資産については為替ヘッジを行いませんでした。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について (プラス要因)

2026年7月にベンチマーク比で韓国ウォンやノルウェークローネ、豪ドルを多め、米ドルを少なめとしていたことなどがプラス要因となりました。

○今後の運用方針

- ・通貨戦略（国別配分）では、景気の相対感などに着目し、ベンチマーク比でメキシコペソや中国元、豪ドルなどを多め、米ドルやユーロなどを少なめとする方針です。
- ・債券戦略では、米国では当面政策金利を据え置く一方、欧州など一部の地域では政策金利は徐々に引き上げられるとの見通しの下、今後の金融政策の織り込みを注視しながら、デュレーションは機動的に操作する方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2026年 2 月11日～2026年 8 月10日)

項 目	第257期～第262期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 6	% 0.026	(a)その他費用＝作成期中のその他費用÷作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(6)	(0.026)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	6	0.026	
作成期中の平均基準価額は、23,013円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注) 各比率は 1 万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第 3 位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2026年2月11日～2026年8月10日)

公社債

			第257期～第262期	
			買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	国債証券	千アメリカドル 10,149	千アメリカドル 11,030
	カナダ	国債証券	千カナダドル 1,088	千カナダドル 989
	メキシコ	特殊債券	千メキシコペソ 14,724	千メキシコペソ 14,551
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	フランス	国債証券	496	1,163
	スペイン	国債証券	1,096	1,994
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 672	千イギリスポンド 195
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローネ 6,992	千スウェーデンクローネ 18,930
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 22,597	千ノルウェークローネ 15,022
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 10,174	千ポーランドズロチ 9,233
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 3,372	千オーストラリアドル 3,663
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランドドル 1,236	千ニュージーランドドル 1,252
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 306	千シンガポールドル 204 (150)
	韓国	国債証券	千韓国ウォン 1,642,322	千韓国ウォン 495,663
	中国	国債証券	千中国元 15,041	千中国元 7,013
	イスラエル	国債証券	千イスラエルシェケル ー	千イスラエルシェケル 1,373

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2026年 2 月11日～2026年 8 月10日)

利害関係人との取引状況

区 分	第257期～第262期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,027	百万円 87	% 2.9	百万円 3,250	百万円 68	% 2.1

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

○組入資産の明細

(2026年8月10日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	第262期末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 10,100	千アメリカドル 10,035	千円 1,585,335	% 38.5	% —	% —	% —	% 38.5
カナダ	千カナダドル 100	千カナダドル 99	11,226	0.3	—	—	—	0.3
メキシコ	千メキシコペソ 29,000	千メキシコペソ 29,076	268,007	6.5	—	—	4.5	2.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
フランス	2,000	1,943	354,917	8.6	—	—	1.3	7.3
スペイン	700	695	127,011	3.1	—	—	—	3.1
国際機関	500	496	90,623	2.2	—	—	—	2.2
イギリス	千イギリスポンド 500	千イギリスポンド 476	101,590	2.5	—	—	0.5	2.0
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 100	千スウェーデンクローネ 97	1,617	0.0	—	—	—	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 7,900	千ノルウェークローネ 7,562	125,768	3.1	—	—	0.2	2.9
ポーランド	千ポーランドズロチ 4,600	千ポーランドズロチ 4,429	188,119	4.6	—	—	4.6	—
オーストラリア	千オーストラリアドル 1,800	千オーストラリアドル 1,698	189,520	4.6	—	—	3.6	1.0
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 100	千ニュージーランドドル 97	9,107	0.2	—	—	0.2	—
シンガポール	千シンガポールドル 100	千シンガポールドル 101	12,560	0.3	—	—	—	0.3
韓国	千韓国ウォン 1,170,000	千韓国ウォン 1,147,150	128,177	3.1	—	—	3.1	—
中国	千中国元 35,000	千中国元 35,141	822,603	20.0	—	—	8.6	11.4
イスラエル	千イスラエルシェケル 400	千イスラエルシェケル 398	20,965	0.5	—	—	0.5	—
合 計	—	—	4,037,153	97.9	—	—	27.0	70.9

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄			第262期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	3.375 T-NOTE 270915	3.375	7,100	7,044	1,112,895	2027/9/15
		4.25 T-NOTE 280731	4.25	1,000	1,001	158,149	2028/7/31
		T-BILL 261001	—	2,000	1,989	314,290	2026/10/1
小 計						1,585,335	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	2.25 CAN GOVT 280201	2.25	100	99	11,226	2028/2/1
小 計						11,226	
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
	特殊債券	7.07 IBRD 290626	7.07	20,000	20,057	184,871	2029/6/26
		7.5 INTL FINAN 280118	7.5	9,000	9,019	83,135	2028/1/18
小 計						268,007	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
	フランス	国債証券 0.75 O.A.T 280225	0.75	1,700	1,646	300,712	2028/2/25
		2.4 O.A.T 280924	2.4	300	296	54,204	2028/9/24
	スペイン	国債証券 2.4 SPAIN GOVT 280531	2.4	700	695	127,011	2028/5/31
	国際機関	特殊債券 2 EUROPEAN U 271004	2.0	500	496	90,623	2027/10/4
小 計						572,553	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
	国債証券	0.125 GILT 280131	0.125	400	378	80,572	2028/1/31
		4.125 GILT 310307	4.125	100	98	21,018	2031/3/7
小 計						101,590	
スウェーデン				千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	国債証券	0.75 SWD GOVT 280512	0.75	100	97	1,617	2028/5/12
小 計						1,617	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	500	461	7,678	2029/9/6
		2 NORWE GOVT 280426	2.0	7,400	7,101	118,090	2028/4/26
小 計						125,768	
ポーランド				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券	4 POLAND 310725	4.0	3,500	3,345	142,082	2031/7/25
		4.5 POLAND 310125	4.5	1,100	1,084	46,036	2031/1/25
小 計						188,119	
オーストラリア				千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
	国債証券	1.5 AUST GOVT 310621	1.5	500	433	48,358	2031/6/21
		2.25 AUST GOVT 280521	2.25	400	384	42,903	2028/5/21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	400	387	43,202	2029/4/21
	特殊債券	4.5 INTL FINAN 300520	4.5	500	493	55,056	2030/5/20
小 計						189,520	
ニュージーランド				千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル		
	国債証券	3 NZ GOVT 290420	3.0	100	97	9,107	2029/4/20
小 計						9,107	
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	2.625 SINGAPOREGOV 280501	2.625	100	101	12,560	2028/5/1
小 計						12,560	

銘	柄	第262期末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
韓国		%	千韓国ウォン	千韓国ウォン	千円	
	国債証券 2.75 KOREA TREASU 281210	2.75	1,170,000	1,147,150	128,177	2028/12/10
小	計				128,177	
中国			千中国元	千中国元		
	国債証券 1.36 CHINA GOVT 271215	1.36	11,000	11,014	257,828	2027/12/15
	1.44 CHINA GOVT 270915	1.44	9,000	9,021	211,185	2027/9/15
	1.54 CHINA GOVT 310125	1.54	12,000	12,074	282,655	2031/1/25
	1.63 CHINA GOVT 301025	1.63	3,000	3,030	70,934	2030/10/25
小	計				822,603	
イスラエル			千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
	国債証券 2.25 ISRAEL FIXED 280928	2.25	400	398	20,965	2028/9/28
小	計				20,965	
合	計				4,037,153	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

○投資信託財産の構成

(2026年8月10日現在)

項 目	第262期末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 4,037,153	% 96.6
コール・ローン等、その他	141,226	3.4
投資信託財産総額	4,178,379	100.0

(注) 作成期末における外貨建純資産（4,113,175千円）の投資信託財産総額（4,178,379千円）に対する比率は98.4%です。

(注) 外貨建資産は、作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、作成期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル＝157.98円	1 カナダドル＝113.26円	1 メキシコペソ＝9.2173円	1 ユーロ＝182.59円
1 イギリスポンド＝213.15円	1 スウェーデンクローネ＝16.65円	1 ノルウェークローネ＝16.63円	1 ポーランドズロチ＝42.4679円
1 オーストラリアドル＝111.61円	1 ニュージーランドドル＝92.96円	1 シンガポールドル＝123.53円	100韓国ウォン＝11.1736円
1 中国元＝23.4085円	1 イスラエルシェケル＝52.6317円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第257期末	第258期末	第259期末	第260期末	第261期末	第262期末
	2026年3月10日現在	2026年4月10日現在	2026年5月11日現在	2026年6月10日現在	2026年7月10日現在	2026年8月10日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	4,544,023,432	4,508,353,410	4,732,079,479	4,403,979,941	4,301,512,985	4,354,258,911
コール・ローン等	193,517,662	265,430,696	35,690,380	51,590,510	88,651,976	15,617,814
公社債(評価額)	4,010,521,356	4,093,306,145	4,175,326,452	4,126,628,022	4,077,238,425	4,037,153,880
未収入金	299,969,695	128,994,712	490,803,955	190,479,220	92,754,249	262,635,088
未収利息	27,427,481	13,996,163	20,679,886	25,238,504	27,483,590	29,968,893
前払費用	12,587,238	6,625,694	9,578,806	10,043,685	15,384,745	8,883,236
(B) 負債	294,352,792	254,354,766	514,529,397	192,848,732	88,354,336	231,542,184
未払金	292,527,306	247,464,997	495,849,589	190,339,216	87,487,001	230,625,477
未払解約金	1,825,486	6,889,769	18,679,808	2,509,516	867,335	916,707
(C) 純資産総額(A－B)	4,249,670,640	4,253,998,644	4,217,550,082	4,211,131,209	4,213,158,649	4,122,716,727
元本	1,869,693,353	1,851,172,514	1,850,314,281	1,819,713,879	1,804,982,253	1,789,111,119
次期繰越損益金	2,379,977,287	2,402,826,130	2,367,235,801	2,391,417,330	2,408,176,396	2,333,605,608
(D) 受益権総口数	1,869,693,353口	1,851,172,514口	1,850,314,281口	1,819,713,879口	1,804,982,253口	1,789,111,119口
1万口当たり基準価額(C/D)	22,729円	22,980円	22,794円	23,142円	23,342円	23,043円

○損益の状況

項 目	第257期	第258期	第259期	第260期	第261期	第262期
	2026年2月11日～ 2026年3月10日	2026年3月11日～ 2026年4月10日	2026年4月11日～ 2026年5月11日	2026年5月12日～ 2026年6月10日	2026年6月11日～ 2026年7月10日	2026年7月11日～ 2026年8月10日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	8,740,040	9,628,510	10,188,459	9,444,298	9,640,571	10,292,591
受取利息	8,740,040	9,628,510	10,188,459	9,444,298	9,640,571	10,292,591
(B) 有価証券売買損益	△ 3,057,371	37,179,794	△ 44,613,366	54,805,824	26,865,212	△ 63,516,837
売買益	32,876,971	54,433,598	5,090,857	67,602,435	37,417,944	15,455,271
売買損	△ 35,934,342	△ 17,253,804	△ 49,704,223	△ 12,796,611	△ 10,552,732	△ 78,972,108
(C) 保管費用等	△ 120,989	△ 166,906	△ 249,772	△ 212,693	△ 203,222	△ 155,463
(D) 当期損益金 (A + B + C)	5,561,680	46,641,398	△ 34,674,679	64,037,429	36,302,561	△ 53,379,709
(E) 前期繰越損益金	2,385,623,618	2,379,977,287	2,402,826,130	2,367,235,801	2,391,417,330	2,408,176,396
(F) 追加信託差損益金	1,660,011	9,441	23,427,251	1,391,213	1,359,892	767,691
(G) 解約差損益金	△ 12,868,022	△ 23,801,996	△ 24,342,901	△ 41,247,113	△ 20,903,387	△ 21,958,770
(H) 計 (D + E + F + G)	2,379,977,287	2,402,826,130	2,367,235,801	2,391,417,330	2,408,176,396	2,333,605,608
次期繰越損益金 (H)	2,379,977,287	2,402,826,130	2,367,235,801	2,391,417,330	2,408,176,396	2,333,605,608

(注) (B) 有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) (G) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

- ①作成期首（前作成期末）元本額 1,878,631,931円
作成期中追加設定元本額 22,051,148円
作成期中一部解約元本額 111,571,960円
また、1口当たり純資産額は、作成期末2,3043円です。
- ②作成期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額）
ワールド短期ソブリンオープン 1,789,111,119円

【お 知 ら せ】

投資信託約款に記載された「一般社団法人投資信託協会」を、「一般社団法人資産運用業協会」に記載変更を行いました。

一般社団法人資産運用業協会設立準備法人を吸収合併存続法人、一般社団法人日本投資顧問業協会と一般社団法人投資信託協会を吸収合併消滅法人として2026年4月1日付で合併し、「一般社団法人資産運用業協会」に名称を変更することとなったため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(2026年4月1日)