

## 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	<ul style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> </ul>	
主な組入制限	ベビーフンド	<ul style="list-style-type: none"> <li>マザーファンドへの投資は、制限を設けません。</li> <li>外貨建資産への実質投資は、制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ul>
	マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> <li>外貨建資産への投資は、制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ul>
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227期（決算日：2023年9月11日）  
 第228期（決算日：2023年10月10日）  
 第229期（決算日：2023年11月10日）  
 第230期（決算日：2023年12月11日）  
 第231期（決算日：2024年1月10日）  
 第232期（決算日：2024年2月13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。  
 さて、お手持ちの「ワールド短期ソブリンオープン」は、去る2月13日に第232期の決算を行いましたので、法令に基づいて第227期～第232期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。  
 今後とも引き続きお引き立て賜りますよう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

お客様専用  
 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 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 分 配	み 金	期 騰 落	中 率			
	円		円	%		%	%	百万円
203期(2021年9月10日)	6,173		5	△0.4	262.83	△0.2	97.7	4,446
204期(2021年10月11日)	6,258		5	1.5	265.80	1.1	97.5	4,475
205期(2021年11月10日)	6,277		5	0.4	267.91	0.8	97.8	4,422
206期(2021年12月10日)	6,227		5	△0.7	265.64	△0.8	98.4	4,361
207期(2022年1月11日)	6,319		5	1.6	269.26	1.4	97.6	4,380
208期(2022年2月10日)	6,302		5	△0.2	269.27	0.0	98.0	4,119
209期(2022年3月10日)	6,248		5	△0.8	266.42	△1.1	97.8	4,051
210期(2022年4月11日)	6,629		5	6.2	281.84	5.8	97.2	4,239
211期(2022年5月10日)	6,797		5	2.6	291.20	3.3	97.2	4,306
212期(2022年6月10日)	7,024		5	3.4	300.32	3.1	97.6	4,389
213期(2022年7月11日)	7,026		5	0.1	299.47	△0.3	97.5	4,363
214期(2022年8月10日)	6,980		5	△0.6	297.93	△0.5	96.9	4,319
215期(2022年9月12日)	7,298		5	4.6	310.19	4.1	96.8	4,495
216期(2022年10月11日)	7,279		5	△0.2	309.90	△0.1	97.6	4,437
217期(2022年11月10日)	7,363		5	1.2	314.22	1.4	95.7	4,450
218期(2022年12月12日)	7,004		5	△4.8	300.52	△4.4	96.6	4,186
219期(2023年1月10日)	6,810		5	△2.7	292.91	△2.5	96.2	4,047
220期(2023年2月10日)	6,791		5	△0.2	290.63	△0.8	96.6	4,013
221期(2023年3月10日)	6,926		5	2.1	298.84	2.8	96.9	4,087
222期(2023年4月10日)	6,906		5	△0.2	296.77	△0.7	97.7	4,069
223期(2023年5月10日)	7,053		5	2.2	304.96	2.8	97.5	4,143
224期(2023年6月12日)	7,185		5	1.9	311.27	2.1	97.3	4,187
225期(2023年7月10日)	7,354		5	2.4	317.94	2.1	97.5	4,242
226期(2023年8月10日)	7,461		5	1.5	323.66	1.8	97.1	4,264
227期(2023年9月11日)	7,534		5	1.0	329.45	1.8	96.8	4,284
228期(2023年10月10日)	7,596		5	0.9	330.34	0.3	97.0	4,318
229期(2023年11月10日)	7,766		5	2.3	339.04	2.6	97.2	4,380
230期(2023年12月11日)	7,554		5	△2.7	328.70	△3.0	98.0	4,254
231期(2024年1月10日)	7,608		5	0.8	332.37	1.1	96.6	4,253
232期(2024年2月13日)	7,812		5	2.7	342.93	3.2	97.6	4,311

(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1-3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	騰 落 率	騰 落 率		
第227期	(期首) 2023年8月10日	円 7,461	% -	323.66	% -	% 97.1	% -
	8月末	7,562	1.4	327.92	1.3	97.4	-
	(期末) 2023年9月11日	7,539	1.0	329.45	1.8	96.8	-
第228期	(期首) 2023年9月11日	7,534	-	329.45	-	96.8	-
	9月末	7,628	1.2	331.86	0.7	96.0	-
	(期末) 2023年10月10日	7,601	0.9	330.34	0.3	97.0	-
第229期	(期首) 2023年10月10日	7,596	-	330.34	-	97.0	-
	10月末	7,644	0.6	332.77	0.7	96.9	-
	(期末) 2023年11月10日	7,771	2.3	339.04	2.6	97.2	-
第230期	(期首) 2023年11月10日	7,766	-	339.04	-	97.2	-
	11月末	7,681	△1.1	336.93	△0.6	97.1	-
	(期末) 2023年12月11日	7,559	△2.7	328.70	△3.0	98.0	-
第231期	(期首) 2023年12月11日	7,554	-	328.70	-	98.0	-
	12月末	7,509	△0.6	326.87	△0.6	96.6	-
	(期末) 2024年1月10日	7,613	0.8	332.37	1.1	96.6	-
第232期	(期首) 2024年1月10日	7,608	-	332.37	-	96.6	-
	1月末	7,747	1.8	340.28	2.4	97.9	-
	(期末) 2024年2月13日	7,817	2.7	342.93	3.2	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合わせるので、「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。

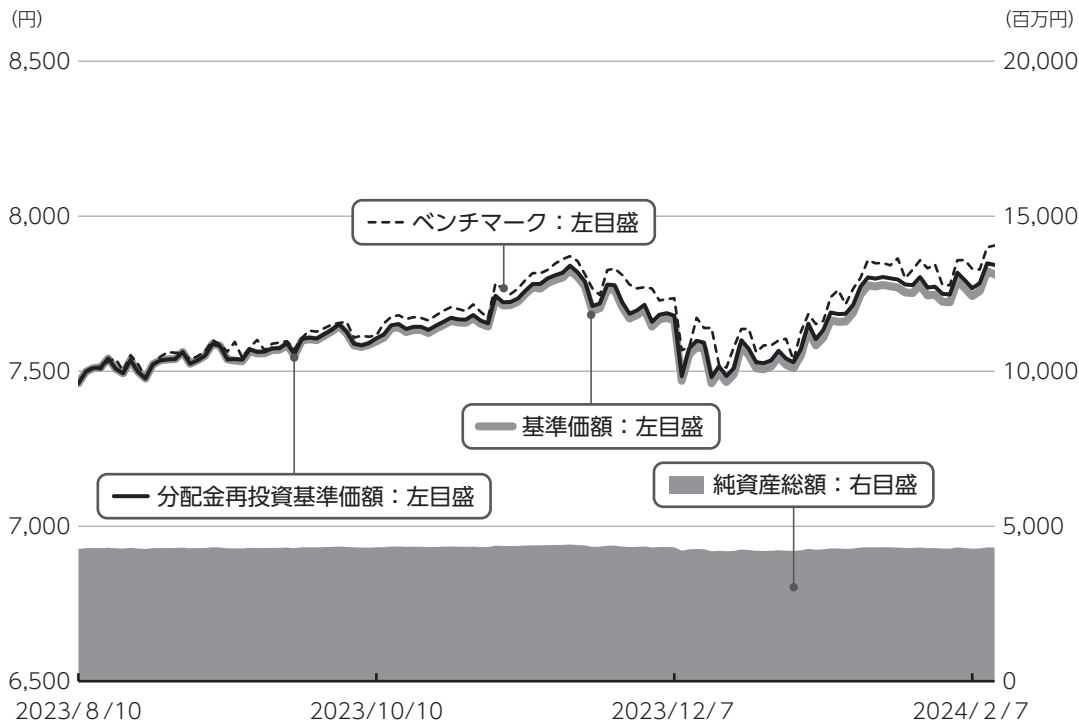
(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

# 運用経過

第227期～第232期：2023年8月11日～2024年2月13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227期首	7,461円
第232期末	7,812円
既払分配金	30円
騰落率	5.1%

(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5.1%（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（6.0%）を0.9%下回りました。

## 基準価額の主な変動要因

### 上昇要因

米ドルやユーロが対円で上昇したことや債券の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227期～第232期：2023年8月11日～2024年2月13日

## 投資環境について

### ▶ 債券市況

**米国・ドイツ・英国の2年債利回りは低下しました。**

2023年12月の米連邦公開市場委員会（FOMC）後に発表されたFOMC参加者の政策金利見通しにおいて2024年の利下げ幅が拡大したことなどや、欧州中央銀行（ECB）による利下げ期待の拡大などから、米国・ドイツ・英国の2年債利回りは低下しました。

### ▶ 為替市況

**米ドル・ユーロ・英ポンドは対円で上昇しました。**

2024年の年初以降、米国を中心に堅調な経済指標が発表され、リスクセンチメントが改善したことなどから、米ドル、ユーロ、英ポンドは対円で上昇しました。

## 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、期間を通じて米ドル・カナダドル・スウェーデンクローナ・ポーランドズロチはベンチマーク比概ね多めとし、中国元を少なめとしました。ユーロは期間の初めベンチマーク比多めとしましたが、2023年10月からベンチマーク比少なめとしました。また、英ポンドを中立から少なめでコントロールしつつ、豪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利上げ織り込みなどを注視し、ベンチマーク比中立を基本にコントロールしました。

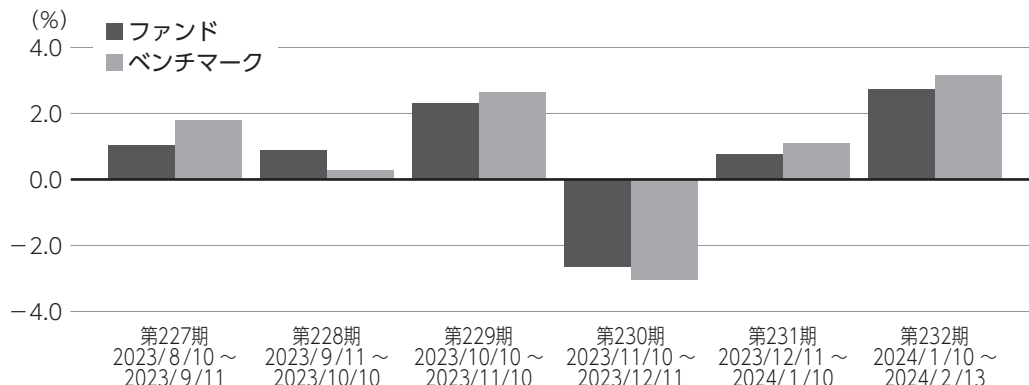
※デュレーションとは、「金利変動に対する債券価格の変動性」を示すもので、債券はデュレーションが大きいほど、金利変動に対する価格の変動が大きくなる傾向があります。

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227期～第232期：2023/8/11～2024/2/13

## ▶ 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（6.0%）を0.9%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)

2023年12月に、米国のデュレーションをベンチマーク比長めにしたことなどがプラス要因となりました。

### (マイナス要因)

2023年10月から11月にかけて、米ドルをベンチマーク比多め、ユーロを少なめとしていたことなどがマイナ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227期 2023年8月11日~ 2023年9月11日	第228期 2023年9月12日~ 2023年10月10日	第229期 2023年10月11日~ 2023年11月10日	第230期 2023年11月11日~ 2023年12月11日	第231期 2023年12月12日~ 2024年1月10日	第232期 2024年1月11日~ 2024年2月13日
当期分配金 (対基準価額比率)	5 (0.066%)	5 (0.066%)	5 (0.064%)	5 (0.066%)	5 (0.066%)	5 (0.064%)
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	268	279	293	300	310	325

(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、ベンチマーク比米ドルなどを多め、ユーロ・中国元などを少なめとする方針です。

債券戦略では、主要先進国の利下げ局面が徐々に近づきつつあるとの見通しの下、今後の政策金利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。

2023年8月11日～2024年2月13日

## 1万口当たりの費用明細

項目	第227期～第232期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	34	0.449	(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 )	(17)	(0.225)	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 )	(15)	(0.197)	交付運用報告書等各种書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
( 受 託 会 社 )	(2)	(0.028)	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	1	0.013	(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 )	(1)	(0.011)	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
合 計	35	0.462	

作成期中の平均基準価額は、7,634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。

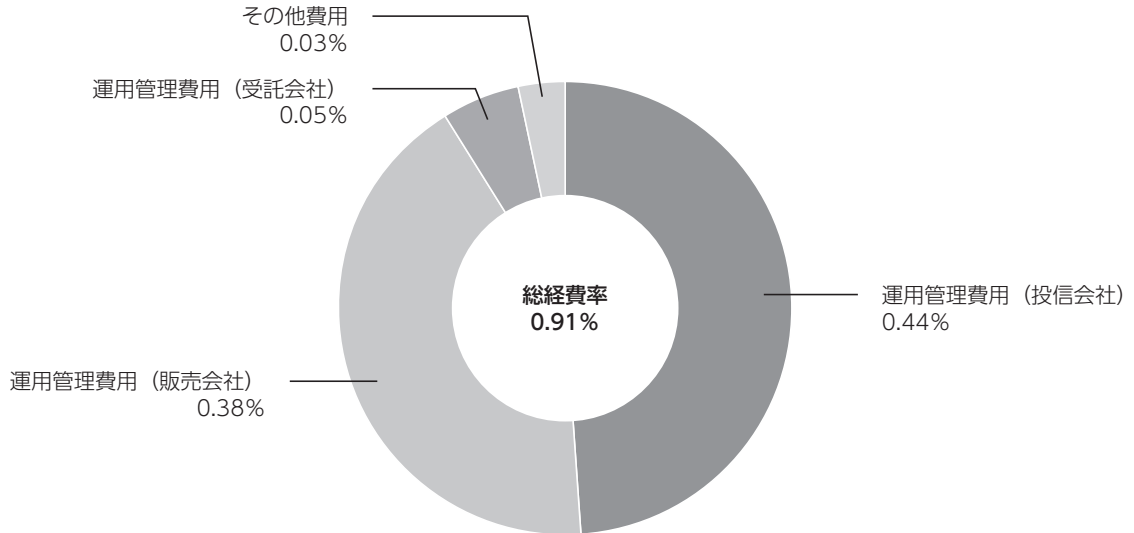
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.91%**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

(2023年8月11日～2024年2月13日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第227期～第232期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ワールド短期ソブリンオープン マザーファンド	千口 21,246	千円 39,807	千口 120,714	千円 226,294

○利害関係人との取引状況等

(2023年8月11日～2024年2月13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227期～第232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	B A	うち利害関係人 との取引状況D	D C		
為替直物取引	百万円 482	百万円 10	% 2.1	百万円 657	百万円 76	% 11.6

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銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2024年2月13日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第226期末	第232期末	
	口 数	口 数	評 価 額
ワールド短期ソブリンオープン マザーファンド	千口 2,327,344	千口 2,227,876	千円 4,295,567

○投資信託財産の構成

(2024年2月13日現在)

項 目	第232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 4,295,567	% 99.5
コール・ローン等、その他	22,142	0.5
投資信託財産総額	4,317,709	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 (4,287,200千円) の投資信託財産総額 (4,297,539千円) に対する比率は99.8%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=149.39円	1 カナダドル=111.05円	1 メキシコペソ=8.7527円	1 ユーロ=160.92円
1 イギリスポンド=188.62円	1 スウェーデンクローネ=14.36円	1 ノルウェークローネ=14.22円	1 ポーランドズロチ=37.3366円
1 オーストラリアドル=97.51円	1 ニュージーランドドル=91.47円	1 シンガポールドル=111.05円	1 中国元=20.7475円
1 イスラエルシェケル=40.8852円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第227期末	第228期末	第229期末	第230期末	第231期末	第232期末
	2023年9月11日現在	2023年10月10日現在	2023年11月10日現在	2023年12月11日現在	2024年1月10日現在	2024年2月13日現在
(A) 資産	円 4,292,199,894	円 4,325,490,974	円 4,391,755,835	円 4,265,086,739	円 4,262,745,467	円 4,317,709,876
コール・ローン等	20,184,024	20,068,671	21,256,206	20,171,729	21,081,768	20,170,057
ワールド短期ソブリンオープン マザーファンド(詳細欄)	4,268,420,257	4,302,462,693	4,364,929,981	4,239,239,596	4,238,285,118	4,295,567,985
未収入金	3,595,613	2,959,610	5,569,648	5,675,414	3,378,581	1,971,834
(B) 負債	8,093,850	7,268,536	10,872,333	10,427,768	8,961,691	6,447,726
未払収益分配金	2,843,325	2,842,255	2,820,414	2,816,244	2,795,595	2,759,487
未払解約金	1,933,950	1,406,730	4,797,689	4,355,696	3,105,262	157,885
未払信託報酬	3,300,051	3,004,519	3,238,044	3,239,636	3,045,610	3,512,802
未払利息	35	16	8	5	8	1
その他未払費用	16,489	15,016	16,178	16,187	15,216	17,551
(C) 純資産総額(A-B)	4,284,106,044	4,318,222,438	4,380,883,502	4,254,658,971	4,253,783,776	4,311,262,150
元本	5,686,651,209	5,684,510,027	5,640,829,330	5,632,489,911	5,591,190,125	5,518,974,360
次期繰越損益金	△1,402,545,165	△1,366,287,589	△1,259,945,828	△1,377,830,940	△1,337,406,349	△1,207,712,210
(D) 受益権総口数	5,686,651,209口	5,684,510,027口	5,640,829,330口	5,632,489,911口	5,591,190,125口	5,518,974,360口
1万口当たり基準価額(C/D)	7,534円	7,596円	7,766円	7,554円	7,608円	7,812円

○損益の状況

項 目	第227期	第228期	第229期	第230期	第231期	第232期
	2023年8月11日～ 2023年9月11日	2023年9月12日～ 2023年10月10日	2023年10月11日～ 2023年11月10日	2023年11月11日～ 2023年12月11日	2023年12月12日～ 2024年1月10日	2024年1月11日～ 2024年2月13日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 953	△ 405	△ 151	△ 161	△ 152	△ 89
支払利息	△ 953	△ 405	△ 151	△ 161	△ 152	△ 89
(B) 有価証券売買損益	47,064,919	41,477,898	101,783,264	△ 113,667,030	36,104,712	118,560,144
売買益	47,697,999	41,821,040	102,176,578	265,485	36,312,204	119,437,090
売買損	△ 633,080	△ 343,142	△ 393,314	△ 113,932,515	△ 207,492	△ 876,946
(C) 信託報酬等	△ 3,316,540	△ 3,019,535	△ 3,254,222	△ 3,255,823	△ 3,060,826	△ 3,530,353
(D) 当期繰損益金 (A + B + C)	43,747,426	38,457,958	98,528,891	△ 116,923,014	33,043,734	115,029,702
(E) 前期繰越損益金	△ 387,969,918	△ 346,226,408	△ 307,560,030	△ 210,403,381	△ 327,249,890	△ 292,738,904
(F) 追加信託差損益金	△1,055,479,348	△1,055,676,884	△1,048,094,275	△1,047,688,301	△1,040,404,598	△1,027,243,521
(配当等相当額)	( 24,195,094)	( 24,470,066)	( 24,551,468)	( 25,247,366)	( 25,271,298)	( 25,122,849)
(売買損益相当額)	(△1,079,674,442)	(△1,080,146,950)	(△1,072,645,743)	(△1,072,935,667)	(△1,065,675,896)	(△1,052,366,370)
(G) 計 (D + E + F)	△1,399,701,840	△1,363,445,334	△1,257,125,414	△1,375,014,696	△1,334,610,754	△1,204,952,723
(H) 収益分配金	△ 2,843,325	△ 2,842,255	△ 2,820,414	△ 2,816,244	△ 2,795,595	△ 2,759,487
次期繰越損益金 (G + H)	△1,402,545,165	△1,366,287,589	△1,259,945,828	△1,377,830,940	△1,337,406,349	△1,207,712,210
追加信託差損益金	△1,055,479,348	△1,055,676,884	△1,048,094,275	△1,047,688,301	△1,040,404,598	△1,027,243,521
(配当等相当額)	( 24,222,737)	( 24,478,962)	( 24,563,975)	( 25,280,011)	( 25,277,374)	( 25,130,380)
(売買損益相当額)	(△1,079,702,085)	(△1,080,155,846)	(△1,072,658,250)	(△1,072,968,312)	(△1,065,681,972)	(△1,052,373,901)
分配準備積立金	128,658,699	134,596,602	140,803,039	144,166,237	148,558,163	154,598,068
繰越損益金	△ 475,724,516	△ 445,207,307	△ 352,654,592	△ 474,308,876	△ 445,559,914	△ 335,066,757

(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 5,716,007,709円  
 作成期中追加設定元本額 90,722,315円  
 作成期中一部解約元本額 287,755,664円  
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.7812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1,207,712,210円です。
- ③分配金の計算過程

項 目	2023年8月11日～ 2023年9月11日	2023年9月12日～ 2023年10月10日	2023年10月11日～ 2023年11月10日	2023年11月11日～ 2023年12月11日	2023年12月12日～ 2024年1月10日	2024年1月11日～ 2024年2月13日
費用控除後の配当等収益額	10,370,262円	9,068,086円	10,259,043円	7,054,947円	8,353,594円	10,807,003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	－円	－円	－円	－円	－円	－円
収益調整金額	24,222,737円	24,478,962円	24,563,975円	25,280,011円	25,277,374円	25,130,380円
分配準備積立金額	121,131,762円	128,370,771円	133,364,410円	139,927,534円	143,000,164円	146,550,552円
当ファンドの分配対象収益額	155,724,761円	161,917,819円	168,187,428円	172,262,492円	176,631,132円	182,487,935円
1万円当たり収益分配対象額	273円	284円	298円	305円	315円	330円
1万円当たり分配金額	5円	5円	5円	5円	5円	5円
収益分配金金額	2,843,325円	2,842,255円	2,820,414円	2,816,244円	2,795,595円	2,759,487円

## ○分配金のお知らせ

	第227期	第228期	第229期	第230期	第231期	第232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】

委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。

2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。

(2023年10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227期》決算日2023年9月11日      《第230期》決算日2023年12月11日  
 《第228期》決算日2023年10月10日      《第231期》決算日2024年1月10日  
 《第229期》決算日2023年11月10日      《第232期》決算日2024年2月13日

[計算期間：2023年8月11日～2024年2月13日]

「ワールド短期ソブリンオープン マザーファンド」は、2月13日に第232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227期～第232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	<ul style="list-style-type: none"> <li>・外貨建資産への投資は、制限を設けません。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>



○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 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
203期(2021年9月10日)	円	%		%	%	%	百万円
204期(2021年10月11日)	14,592	△0.3	262.83	△0.2	98.1	—	4,429
205期(2021年11月10日)	14,818	1.5	265.80	1.1	97.9	—	4,458
206期(2021年12月10日)	14,885	0.5	267.91	0.8	98.2	—	4,405
207期(2022年1月11日)	14,790	△0.6	265.64	△0.8	98.7	—	4,344
208期(2022年2月10日)	15,032	1.6	269.26	1.4	98.0	—	4,363
209期(2022年2月10日)	15,014	△0.1	269.27	0.0	98.3	—	4,103
209期(2022年3月10日)	14,908	△0.7	266.42	△1.1	98.2	—	4,036
210期(2022年4月11日)	15,845	6.3	281.84	5.8	97.5	—	4,223
211期(2022年5月10日)	16,270	2.7	291.20	3.3	97.6	—	4,289
212期(2022年6月10日)	16,841	3.5	300.32	3.1	98.0	—	4,372
213期(2022年7月11日)	16,870	0.2	299.47	△0.3	97.8	—	4,347
214期(2022年8月10日)	16,784	△0.5	297.93	△0.5	97.2	—	4,303
215期(2022年9月12日)	17,576	4.7	310.19	4.1	97.2	—	4,479
216期(2022年10月11日)	17,556	△0.1	309.90	△0.1	98.0	—	4,420
217期(2022年11月10日)	17,784	1.3	314.22	1.4	96.0	—	4,434
218期(2022年12月12日)	16,939	△4.8	300.52	△4.4	97.0	—	4,170
219期(2023年1月10日)	16,493	△2.6	292.91	△2.5	96.6	—	4,032
220期(2023年2月10日)	16,470	△0.1	290.63	△0.8	96.9	—	3,998
221期(2023年3月10日)	16,822	2.1	298.84	2.8	97.3	—	4,071
222期(2023年4月10日)	16,799	△0.1	296.77	△0.7	98.1	—	4,054
223期(2023年5月10日)	17,181	2.3	304.96	2.8	97.9	—	4,127
224期(2023年6月12日)	17,531	2.0	311.27	2.1	97.7	—	4,172
225期(2023年7月10日)	17,968	2.5	317.94	2.1	97.8	—	4,227
226期(2023年8月10日)	18,258	1.6	323.66	1.8	97.5	—	4,249
227期(2023年9月11日)	18,462	1.1	329.45	1.8	97.2	—	4,268
228期(2023年10月10日)	18,642	1.0	330.34	0.3	97.3	—	4,302
229期(2023年11月10日)	19,087	2.4	339.04	2.6	97.6	—	4,364
230期(2023年12月11日)	18,589	△2.6	328.70	△3.0	98.4	—	4,239
231期(2024年1月10日)	18,749	0.9	332.37	1.1	97.0	—	4,238
232期(2024年2月13日)	19,281	2.8	342.93	3.2	98.0	—	4,295

(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1-3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	騰 落 率	騰 落 率		
第227期	(期首) 2023年8月10日	円 18,258	% -	323.66	% -	% 97.5	% -
	8月末	18,515	1.4	327.92	1.3	97.7	-
	(期末) 2023年9月11日	18,462	1.1	329.45	1.8	97.2	-
第228期	(期首) 2023年9月11日	18,462	-	329.45	-	97.2	-
	9月末	18,701	1.3	331.86	0.7	96.3	-
	(期末) 2023年10月10日	18,642	1.0	330.34	0.3	97.3	-
第229期	(期首) 2023年10月10日	18,642	-	330.34	-	97.3	-
	10月末	18,769	0.7	332.77	0.7	97.2	-
	(期末) 2023年11月10日	19,087	2.4	339.04	2.6	97.6	-
第230期	(期首) 2023年11月10日	19,087	-	339.04	-	97.6	-
	11月末	18,886	△1.1	336.93	△0.6	97.4	-
	(期末) 2023年12月11日	18,589	△2.6	328.70	△3.0	98.4	-
第231期	(期首) 2023年12月11日	18,589	-	328.70	-	98.4	-
	12月末	18,487	△0.5	326.87	△0.6	96.8	-
	(期末) 2024年1月10日	18,749	0.9	332.37	1.1	97.0	-
第232期	(期首) 2024年1月10日	18,749	-	332.37	-	97.0	-
	1月末	19,103	1.9	340.28	2.4	98.2	-
	(期末) 2024年2月13日	19,281	2.8	342.93	3.2	98.0	-

(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

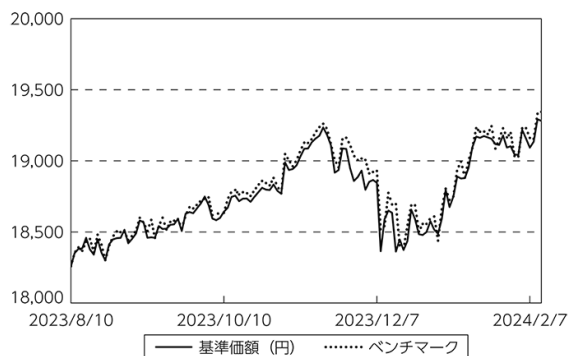
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ5.6%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(6.0%)を0.4%下回りました。

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。

●基準価額の変動要因

(上昇要因)

米ドルやユーロが対円で上昇したことや債券の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。

●投資環境について

◎債券市況

- ・米国・ドイツ・英国の2年債利回りは低下しました。
- ・2023年12月の米連邦公開市場委員会(FOMC)後に発表されたFOMC参加者の政策金利見通しにおいて2024年の利下げ幅が拡大したことなどや、欧州中央銀行(ECB)による利下げ期待の拡大などから、米国・ドイツ・英国の2年債利回りは低下しました。

◎為替市況

- ・米ドル・ユーロ・英ポンドは対円で上昇しました。
- ・2024年の年初以降、米国を中心に堅調な経済指標が発表され、リスクセンチメントが改善したことなどから、米ドル、ユーロ、英ポンドは対円で上昇しました。

●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、期間を通じて米ドル・カナダドル・スウェーデンクローナ・ポーランドズロチはベンチマーク比概ね多めとし、中国元を少なめとしました。ユーロは期間の初めベンチマーク比多めとしましたが、2023年10月からベンチマーク比少なめとしました。また、英ポンドを中立から少なめでコントロールしつつ、豪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利上げ織り込みなどを注視し、ベンチマーク比中立を基本にコントロールしました。  
※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)

2023年12月に、米国のデュレーションをベンチマーク比長めにしたことなどがプラス要因となりました。

### (マイナス要因)

2023年10月から11月にかけて、米ドルをベンチマーク比多め、ユーロを少なめとしていたことなどがマイナ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、ベンチマーク比米ドルなどを多め、ユーロ・中国元などを少なめとする方針です。
- ・債券戦略では、主要先進国の利下げ局面が徐々に近づきつつあるとの見通しの下、今後の政策金利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

(2023年 8 月11日～2024年 2 月13日)

項 目	第227期～第232期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 ( 保 管 費 用 )	円 2 (2)	% 0.011 (0.011)	(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  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
合 計	2	0.011	
作成期中の平均基準価額は、18,758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

(2023年8月11日～2024年2月13日)

公社債

			第227期～第232期	
			買付額	売付額
外          国	アメリカ	国債証券	千アメリカドル 5,767	千アメリカドル 5,095
	カナダ	国債証券	千カナダドル 1,693	千カナダドル 1,694
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	スペイン	国債証券	2,163	1,361
	アイルランド	国債証券	288	2,667
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローネ 4,774	千スウェーデンクローネ -
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 191	千ノルウェークローネ 194
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル -	千オーストラリアドル 887
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 147	千シンガポールドル 149
	中国	国債証券	千中国元 8,034	千中国元 4,006
イスラエル	国債証券	千イスラエルシェケル -	千イスラエルシェケル 480	

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2023年8月11日～2024年2月13日)

利害関係人との取引状況

区 分	第227期～第232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 482	百万円 10	% 2.1	百万円 657	百万円 76	% 11.6

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銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2024年2月13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232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 17,800	千アメリカドル 17,468	千円 2,609,672	% 60.8	% —	% —	% 25.8	% 34.9
カナダ	千カナダドル 1,100	千カナダドル 1,043	115,911	2.7	—	—	1.4	1.3
メキシコ	千メキシコペソ 5,000	千メキシコペソ 4,521	39,573	0.9	—	—	—	0.9
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
スペイン	3,750	3,698	595,220	13.9	—	—	10.2	3.7
アイルランド	1,300	1,216	195,728	4.6	—	—	4.6	—
国際機関	1,000	1,024	164,850	3.8	—	—	—	3.8
イギリス	千イギリスポンド 600	千イギリスポンド 572	107,903	2.5	—	—	0.6	1.9
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 5,700	千スウェーデンクローネ 5,530	79,415	1.8	—	—	0.8	1.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 300	千ノルウェークローネ 288	4,102	0.1	—	—	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 1,200	千ポーランドズロチ 1,059	39,559	0.9	—	—	0.9	—
オーストラリア	千オーストラリアドル 150	千オーストラリアドル 138	13,458	0.3	—	—	0.3	—
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 150	千ニュージーランドドル 145	13,309	0.3	—	—	—	0.3
シンガポール	千シンガポールドル 150	千シンガポールドル 146	16,308	0.4	—	—	0.4	—
中国	千中国元 10,000	千中国元 10,054	208,605	4.9	—	—	3.9	1.0
イスラエル	千イスラエルシェケル 100	千イスラエルシェケル 97	3,996	0.1	—	—	—	0.1
合 計	—	—	4,207,614	98.0	—	—	49.0	49.0

(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232期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					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	2.625 T-NOTE 251231	2.625	3,800	3,673	548,788	2025/12/31	
	3 T-NOTE 250715	3.0	4,500	4,399	657,168	2025/7/15	
	3.25 T-NOTE 270630	3.25	2,500	2,424	362,161	2027/6/30	
	4.375 T-NOTE 260815	4.375	5,000	5,004	747,650	2026/8/15	
特殊債券	3.625 INTL FINAN 250915	3.625	2,000	1,967	293,903	2025/9/15	
小計					2,609,672		
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	1.25 CAN GOVT 270301	1.25	600	554	61,627	2027/3/1	
	3 CAN GOVT 251001	3.0	500	488	54,283	2025/10/1	
小計					115,911		
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
特殊債券	4.25 IBRD 260122	4.25	5,000	4,521	39,573	2026/1/22	
小計					39,573		
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
スペイン	国債証券	1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	600	574	92,528	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,000	980	157,853	2025/4/30
		2.8 SPAIN GOVT 260531	2.8	2,150	2,142	344,838	2026/5/31
アイルランド	国債証券	0.2 IRISH GOVT 270515	0.2	1,000	927	149,193	2027/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	300	289	46,534	2026/5/15
国際機関	特殊債券	4.5 EIB 251015	4.5	1,000	1,024	164,850	2025/10/15
小計					955,799		
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券	0.25 GILT 250131	0.25	450	431	81,328	2025/1/31	
	1.5 GILT 260722	1.5	150	140	26,574	2026/7/22	
小計					107,903		
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	1,500	1,399	20,097	2028/5/12	
	1 SWD GOVT 261112	1.0	1,000	957	13,747	2026/11/12	
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	3,200	3,173	45,570	2025/5/12	
小計					79,415		
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	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	200	191	2,716	2026/2/19	
	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	100	97	1,385	2025/3/13	
小計					4,102		
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	0.25 POLAND 261025	0.25	1,200	1,059	39,559	2026/10/25	
小計					39,559		
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	0.5 AUST GOVT 260921	0.5	150	138	13,458	2026/9/21	
小計					13,458		
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	2.75 NZ GOVT 250415	2.75	150	145	13,309	2025/4/15	
小計					13,309		

銘柄	利 率	額面金額	第232期末		償還年月日
			評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
シンガポール	%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
国債証券 2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	150	146	16,308	2026/6/1
小 計				16,308	
中国		千中国元	千中国元		
国債証券 2.24 CHINA GOVT 250525	2.24	2,000	2,001	41,523	2025/5/25
2.39 CHINA GOVT 261115	2.39	4,000	4,021	83,430	2026/11/15
2.48 CHINA GOVT 270415	2.48	4,000	4,031	83,650	2027/4/15
小 計				208,605	
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 1.75 ISRAEL FIXED 250831	1.75	100	97	3,996	2025/8/31
小 計				3,996	
合 計				4,207,614	

(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

(2024年2月13日現在)

項 目	第232期末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 4,207,614	% 97.9
コール・ローン等、その他	89,925	2.1
投資信託財産総額	4,297,539	100.0

(注) 作成期末における外貨建純資産 (4,287,200千円) の投資信託財産総額 (4,297,539千円) に対する比率は99.8%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=149.39円	1 カナダドル=111.05円	1 メキシコペソ=8.7527円	1 ユーロ=160.92円
1 イギリスポンド=188.62円	1 スウェーデンクローネ=14.36円	1 ノルウェークローネ=14.22円	1 ポーランドズロチ=37.3366円
1 オーストラリアドル=97.51円	1 ニュージーランドドル=91.47円	1 シンガポールドル=111.05円	1 中国元=20.7475円
1 イスラエルシェケル=40.8852円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第227期末	第228期末	第229期末	第230期末	第231期末	第232期末
	2023年9月11日現在	2023年10月10日現在	2023年11月10日現在	2023年12月11日現在	2024年1月10日現在	2024年2月13日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	4,287,870,636	4,305,354,236	4,377,984,697	4,256,197,282	4,241,603,362	4,297,539,831
コール・ローン等	50,679,746	76,127,943	66,361,549	28,811,122	94,181,535	46,005,274
公社債(評価額)	4,147,935,342	4,187,328,831	4,258,901,735	4,170,302,632	4,109,254,333	4,207,614,930
未収入金	48,262,430	—	7,562,600	11,192,100	—	—
未収利息	30,204,042	32,498,892	39,726,595	34,132,464	27,161,627	24,588,268
前払費用	10,789,076	9,398,570	5,432,218	11,758,964	11,005,867	19,331,359
(B) 負債	19,341,789	2,959,618	13,136,377	16,867,151	3,378,585	1,971,834
未払金	15,746,170	—	7,566,725	11,191,737	—	—
未払解約金	3,595,613	2,959,610	5,569,648	5,675,414	3,378,581	1,971,834
未払利息	6	8	4	—	4	—
(C) 純資産総額(A-B)	4,268,528,847	4,302,394,618	4,364,848,320	4,239,330,131	4,238,224,777	4,295,567,997
元本	2,312,003,173	2,307,940,507	2,286,860,157	2,280,509,762	2,260,539,292	2,227,876,140
次期繰越損益金	1,956,525,674	1,994,454,111	2,077,988,163	1,958,820,369	1,977,685,485	2,067,691,857
(D) 受益権総口数	2,312,003,173口	2,307,940,507口	2,286,860,157口	2,280,509,762口	2,260,539,292口	2,227,876,140口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,462円	18,642円	19,087円	18,589円	18,749円	19,281円

○損益の状況

項 目	第227期	第228期	第229期	第230期	第231期	第232期
	2023年8月11日～ 2023年9月11日	2023年9月12日～ 2023年10月10日	2023年10月11日～ 2023年11月10日	2023年11月11日～ 2023年12月11日	2023年12月12日～ 2024年1月10日	2024年1月11日～ 2024年2月13日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	11,144,767	9,739,108	10,719,473	10,202,919	9,221,062	11,235,282
受取利息	11,145,636	9,739,545	10,719,580	10,203,067	9,221,164	11,235,378
支払利息	△ 869	△ 437	△ 107	△ 148	△ 102	△ 96
(B) 有価証券売買損益	36,519,973	31,800,172	91,446,274	△ 123,691,455	26,683,659	108,339,655
売買益	54,193,214	39,486,767	95,410,167	27,229,326	40,060,449	118,240,217
売買損	△ 17,673,241	△ 7,686,595	△ 3,963,893	△ 150,920,781	△ 13,376,790	△ 9,900,562
(C) 保管費用等	△ 5,206	△ 182,167	△ 5,462	△ 211,444	△ 2,595	△ 77,491
(D) 当期損益金(A+B+C)	47,659,534	41,357,113	102,160,285	△ 113,699,980	35,902,126	119,497,446
(E) 前期繰越損益金	1,921,834,727	1,956,525,674	1,994,454,111	2,077,988,163	1,958,820,369	1,977,685,485
(F) 追加信託差損益金	3,816,829	3,986,239	1,418,786	7,666,452	—	1,672,625
(G) 解約差損益金	△ 16,785,416	△ 7,414,915	△ 20,045,019	△ 13,134,266	△ 17,037,010	△ 31,163,699
(H) 計(D+E+F+G)	1,956,525,674	1,994,454,111	2,077,988,163	1,958,820,369	1,977,685,485	2,067,691,857
次期繰越損益金(H)	1,956,525,674	1,994,454,111	2,077,988,163	1,958,820,369	1,977,685,485	2,067,691,857

(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 2,327,344,402円  
 作成期中追加設定元本額 21,246,221円  
 作成期中一部解約元本額 120,714,483円  
 また、1口当たり純資産額は、作成期末1,9281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 2,227,876,140円

【お知らせ】

委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。  
 2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。  
 (2023年10月1日)