

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"> 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	ベビーフンド	<ul style="list-style-type: none"> 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	<ul style="list-style-type: none"> 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233期（決算日：2024年3月11日）
 第234期（決算日：2024年4月10日）
 第235期（決算日：2024年5月10日）
 第236期（決算日：2024年6月10日）
 第237期（決算日：2024年7月10日）
 第238期（決算日：2024年8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8月13日に第238期の決算を行いましたので、法令に基づいて第233期～第238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			FTSE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	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込 分配	み 金 騰 落 率	期 騰 落 率	期 騰 落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
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
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

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) FTSE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。

FTSE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233期	(期首) 2024年2月13日	円 7,812	% —	342.93	% —	% 97.6	% —
	2月末	7,874	0.8	346.24	1.0	97.4	—
	(期末) 2024年3月11日	7,729	△1.1	340.29	△0.8	97.1	—
第234期	(期首) 2024年3月11日	7,724	—	340.29	—	97.1	—
	3月末	7,918	2.5	348.31	2.4	96.3	—
	(期末) 2024年4月10日	7,954	3.0	349.53	2.7	97.1	—
第235期	(期首) 2024年4月10日	7,949	—	349.53	—	97.1	—
	4月末	8,158	2.6	359.06	2.7	97.7	—
	(期末) 2024年5月10日	8,137	2.4	358.27	2.5	97.1	—
第236期	(期首) 2024年5月10日	8,132	—	358.27	—	97.1	—
	5月末	8,201	0.8	361.55	0.9	96.8	—
	(期末) 2024年6月10日	8,196	0.8	362.11	1.1	94.7	—
第237期	(期首) 2024年6月10日	8,191	—	362.11	—	94.7	—
	6月末	8,416	2.7	371.32	2.5	94.7	—
	(期末) 2024年7月10日	8,500	3.8	375.15	3.6	94.6	—
第238期	(期首) 2024年7月10日	8,495	—	375.15	—	94.6	—
	7月末	8,034	△5.4	361.38	△3.7	95.8	—
	(期末) 2024年8月13日	7,840	△7.7	349.00	△7.0	96.1	—

(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233期～第238期：2024年2月14日～2024年8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233期首	7,812円
第238期末	7,835円
既払分配金	30円
騰落率	0.7%

(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0.7%（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（1.8%）を1.1%下回りました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

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。

下落要因

米ドルやメキシコペソが対円で下落したことなどが基準価額の下落要因となりました。

第233期～第238期：2024年2月14日～2024年8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。

米国2年債利回りは、米連邦準備制度理事会（F R B）高官が早期の利下げをけん制したことなどを受けて、年内の利下げ織り込みが一部剥落したことなどから、上昇する場面もありましたが、米国における軟調な内容の経済指標などを受けて、期間を通じてみると低下しました。ドイツ、英国の2年債利回りは米国2年債利回りに概ね連動する形で低下しました。

▶ 為替市況

米ドル・英ポンドは対円で下落、ユーロは対円で概ね横ばいとなりました。

円安が進行する中、日銀が金融政策の正常化を慎重に進めていることなどが米ドル・ユーロ・英ポンドの対円での上昇要因となった一方、主要国金利が低下し、本邦との金利差が縮小したことなどが下落要因となりました。結果、期間を通じてみると、米ドル・英ポンドは対円で下落、ユーロは対円で概ね横ばいとなりました。

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・スウェーデンクローネ・ノルウェークローネ・ポーランドズロチはベンチマーク比概ね多めとし、ユーロ・英ポンド・中国元を少なめとしました。また、カナダドルを中立から多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。

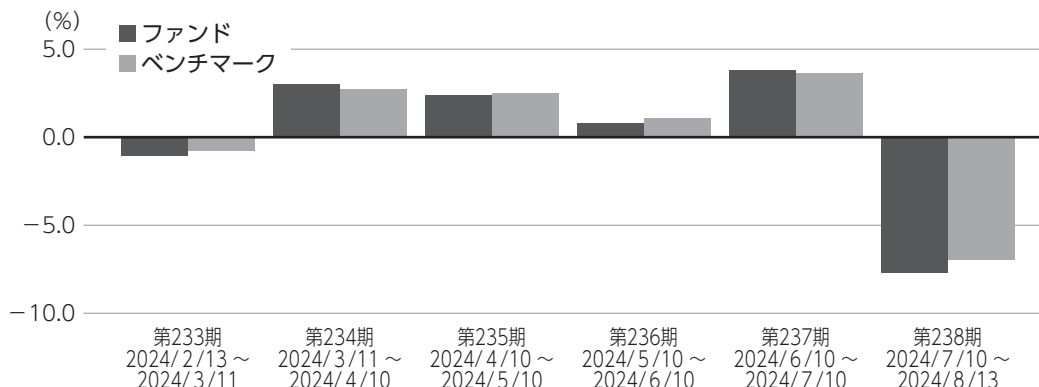
※デュレーションとは、「金利変動に対する債券価格の変動性」を示すもので、債券はデュレーションが大きいほど、金利変動に対する価格の変動が大きくなる傾向があります。

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233期～第238期：2024/2/14～2024/8/13

▶ 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（1.8%）を1.1%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)

期間を通じて、ポーランドズロチをベンチマーク比多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)

2024年6月以降、ノルウェークローネやメキシコペソをベンチマーク比多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233期 2024年2月14日~ 2024年3月11日	第234期 2024年3月12日~ 2024年4月10日	第235期 2024年4月11日~ 2024年5月10日	第236期 2024年5月11日~ 2024年6月10日	第237期 2024年6月11日~ 2024年7月10日	第238期 2024年7月11日~ 2024年8月13日
当期分配金 (対基準価額比率)	5 (0.065%)	5 (0.063%)	5 (0.061%)	5 (0.061%)	5 (0.059%)	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	333	347	363	377	407	418

(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、ベンチマーク比スウェーデンクローネ・ノルウェークローネなどを多め、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。

2024年2月14日～2024年8月13日

1万口当たりの費用明細

項目	第233期～第238期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a)信託報酬	35	0.438	(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）	(18)	(0.219)	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）	(16)	(0.192)	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	2	0.019	(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)	(0.017)	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	37	0.457	

作成期中の平均基準価額は、8,078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。

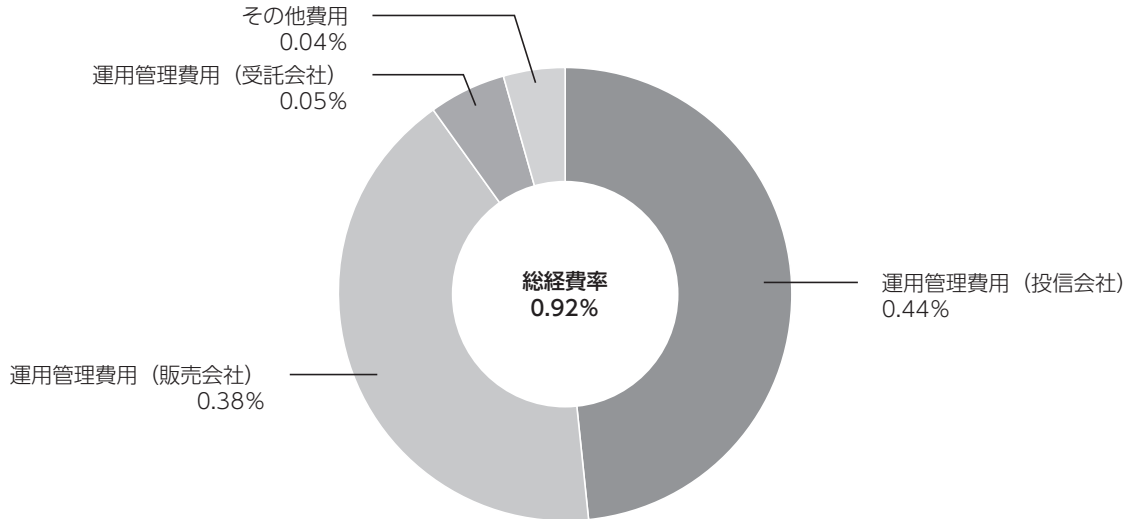
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.92%**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

(2024年2月14日～2024年8月13日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第233期～第238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 31,805	千円 63,756	千口 112,734	千円 224,229

○利害関係人との取引状況等

(2024年2月14日～2024年8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233期～第238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 1,019	百万円 —	% —	百万円 1,180	百万円 31	% 2.6

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

(2024年8月13日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第232期末	第238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 2,227,876	千口 2,146,946	千円 4,186,116

○投資信託財産の構成

(2024年8月13日現在)

項 目	第238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 4,186,116	% 99.5
コール・ローン等、その他	21,573	0.5
投資信託財産総額	4,207,689	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 (4,177,646千円) の投資信託財産総額 (4,187,739千円) 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=147.34円	1 カナダドル=107.19円	1 メキシコペソ=7.7334円	1 ユーロ=161.04円
1 イギリスポンド=188.09円	1 スウェーデンクローネ=14.00円	1 ノルウェークローネ=13.63円	1 ポーランドズロチ=37.3936円
1 オーストラリアドル=96.95円	1 ニュージーランドドル=88.76円	1 シンガポールドル=111.26円	1 中国元=20.53円
1 イスラエルシェケル=38.8994円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第233期末	第234期末	第235期末	第236期末	第237期末	第238期末
	2024年3月11日現在	2024年4月10日現在	2024年5月10日現在	2024年6月10日現在	2024年7月10日現在	2024年8月13日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	4,254,075,672	4,357,379,036	4,424,833,904	4,434,534,830	4,589,190,503	4,207,689,374
コール・ローン等	19,714,663	20,783,745	20,740,578	20,550,229	22,718,330	19,910,533
ワールド短期ソブリンオープン マザーファンド(詳細欄)	4,220,695,169	4,335,708,514	4,400,908,495	4,411,967,477	4,565,417,464	4,186,116,289
未収入金	13,665,840	886,740	3,184,792	2,017,085	1,054,666	1,662,432
未収利息	—	37	39	39	43	120
(B) 負債	17,858,738	5,884,567	7,992,074	6,615,347	7,392,120	6,282,519
未払収益分配金	2,742,153	2,736,995	2,715,803	2,702,942	2,696,759	2,681,099
未払解約金	12,301,865	12,707	2,088,816	586,526	1,420,281	3,957
未払信託報酬	2,800,718	3,119,280	3,171,607	3,309,341	3,258,797	3,579,575
未払利息	4	—	—	—	—	—
その他未払費用	13,998	15,585	15,848	16,538	16,283	17,888
(C) 純資産総額(A-B)	4,236,216,934	4,351,494,469	4,416,841,830	4,427,919,483	4,581,798,383	4,201,406,855
元本	5,484,307,338	5,473,991,525	5,431,606,825	5,405,884,827	5,393,518,653	5,362,198,723
次期繰越損益金	△1,248,090,404	△1,122,497,056	△1,014,764,995	△ 977,965,344	△ 811,720,270	△1,160,791,868
(D) 受益権総口数	5,484,307,338口	5,473,991,525口	5,431,606,825口	5,405,884,827口	5,393,518,653口	5,362,198,723口
1万口当たり基準価額(C/D)	7.724円	7.949円	8.132円	8.191円	8.495円	7.835円

○損益の状況

項 目	第233期	第234期	第235期	第236期	第237期	第238期
	2024年2月14日～ 2024年3月11日	2024年3月12日～ 2024年4月10日	2024年4月11日～ 2024年5月10日	2024年5月11日～ 2024年6月10日	2024年6月11日～ 2024年7月10日	2024年7月11日～ 2024年8月13日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 35	528	853	937	867	1,909
受取利息	—	535	853	937	867	1,909
支払利息	△ 35	△ 7	—	—	—	—
(B) 有価証券売買損益	△ 42,679,567	129,008,564	104,804,791	37,646,041	169,680,704	△ 347,106,980
売買益	144,647	129,438,914	105,132,620	38,048,747	170,409,072	1,766,985
売買損	△ 42,824,214	△ 430,350	△ 327,829	△ 402,706	△ 728,368	△ 348,873,965
(C) 信託報酬等	△ 2,814,716	△ 3,134,865	△ 3,187,455	△ 3,325,879	△ 3,275,080	△ 3,597,463
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 45,494,318	125,874,227	101,618,189	34,321,099	166,406,491	△ 350,702,534
(E) 前期繰越損益金	△ 178,230,452	△ 225,810,726	△ 101,657,387	△ 2,648,335	28,856,240	191,112,798
(F) 追加信託差損益金	△1,021,623,481	△1,019,823,562	△1,012,009,994	△1,006,935,166	△1,004,286,242	△ 998,521,033
(配当等相当額)	(25,843,121)	(25,975,667)	(26,027,100)	(26,949,064)	(27,395,457)	(27,651,569)
(売買損益相当額)	(△1,047,466,602)	(△1,045,799,229)	(△1,038,037,094)	(△1,033,884,230)	(△1,031,681,699)	(△1,026,172,602)
(G) 計(D+E+F)	△1,245,348,251	△1,119,760,061	△1,012,049,192	△ 975,262,402	△ 809,023,511	△1,158,110,769
(H) 収益分配金	△ 2,742,153	△ 2,736,995	△ 2,715,803	△ 2,702,942	△ 2,696,759	△ 2,681,099
次期繰越損益金(G+H)	△1,248,090,404	△1,122,497,056	△1,014,764,995	△ 977,965,344	△ 811,720,270	△1,160,791,868
追加信託差損益金	△1,021,623,481	△1,019,823,562	△1,012,009,994	△1,006,935,166	△1,004,286,242	△ 998,521,033
(配当等相当額)	(25,875,921)	(25,981,077)	(26,037,966)	(26,994,654)	(27,409,261)	(27,662,444)
(売買損益相当額)	(△1,047,499,402)	(△1,045,804,639)	(△1,038,047,960)	(△1,033,929,820)	(△1,031,695,503)	(△1,026,183,477)
分配準備積立金	156,961,604	164,408,848	171,232,819	177,273,751	192,565,972	196,492,652
繰越損益金	△ 383,428,527	△ 267,082,342	△ 173,987,820	△ 148,303,929	—	△ 358,763,487

(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 5,518,974,360円
 作成期中追加設定元本額 102,901,193円
 作成期中一部解約元本額 259,676,830円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.7835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1,160,791,868円です。

③分配金の計算過程

項 目	2024年2月14日～ 2024年3月11日	2024年3月12日～ 2024年4月10日	2024年4月11日～ 2024年5月10日	2024年5月11日～ 2024年6月10日	2024年6月11日～ 2024年7月10日	2024年7月11日～ 2024年8月13日
費用控除後の配当等収益額	6,858,304円	10,611,794円	10,993,092円	10,511,761円	10,344,384円	8,060,953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	8,484,372円	—円
収益調整金額	25,875,921円	25,981,077円	26,037,966円	26,994,654円	27,409,261円	27,662,444円
分配準備積立金額	152,845,453円	156,534,049円	162,955,530円	169,464,932円	176,433,975円	191,112,798円
当ファンドの分配対象収益額	185,579,678円	193,126,920円	199,986,588円	206,971,347円	222,671,992円	226,836,195円
1万口当たり収益分配対象額	338円	352円	368円	382円	412円	423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	2,742,153円	2,736,995円	2,715,803円	2,702,942円	2,696,759円	2,681,099円

○分配金のお知らせ

	第233期	第234期	第235期	第236期	第237期	第238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。

ワールド短期ソブリンオープン マザーファンド

《第233期》決算日2024年3月11日

《第236期》決算日2024年6月10日

《第234期》決算日2024年4月10日

《第237期》決算日2024年7月10日

《第235期》決算日2024年5月10日

《第238期》決算日2024年8月13日

[計算期間：2024年2月14日～2024年8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、8月13日に第238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233期～第238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"> ・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 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
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

(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233期	(期首) 2024年2月13日	円 19,281	% -	342.93	% -	% 98.0	% -
	2月末	19,442	0.8	346.24	1.0	97.7	-
	(期末) 2024年3月11日	19,089	△1.0	340.29	△0.8	97.5	-
第234期	(期首) 2024年3月11日	19,089	-	340.29	-	97.5	-
	3月末	19,578	2.6	348.31	2.4	96.6	-
	(期末) 2024年4月10日	19,674	3.1	349.53	2.7	97.4	-
第235期	(期首) 2024年4月10日	19,674	-	349.53	-	97.4	-
	4月末	20,202	2.7	359.06	2.7	98.0	-
	(期末) 2024年5月10日	20,154	2.4	358.27	2.5	97.5	-
第236期	(期首) 2024年5月10日	20,154	-	358.27	-	97.5	-
	5月末	20,336	0.9	361.55	0.9	97.1	-
	(期末) 2024年6月10日	20,329	0.9	362.11	1.1	95.0	-
第237期	(期首) 2024年6月10日	20,329	-	362.11	-	95.0	-
	6月末	20,898	2.8	371.32	2.5	95.0	-
	(期末) 2024年7月10日	21,114	3.9	375.15	3.6	95.0	-
第238期	(期首) 2024年7月10日	21,114	-	375.15	-	95.0	-
	7月末	19,976	△5.4	361.38	△3.7	96.1	-
	(期末) 2024年8月13日	19,498	△7.7	349.00	△7.0	96.4	-

(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

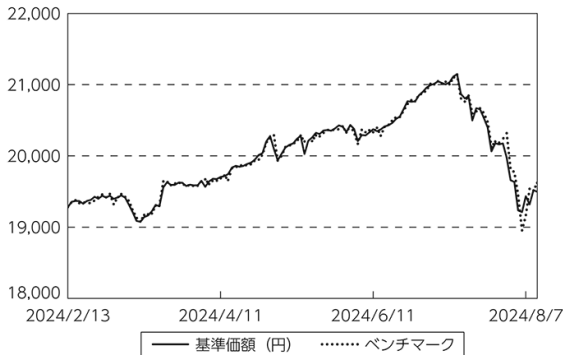
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ1.1%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(1.8%)を0.7%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)

- ・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。

(下落要因)

- ・米ドルやメキシコペソが対円で下落したことが基準価額の下落要因となりました。

●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。
- ・米国2年債利回りは、米連邦準備制度理事会(FRB)高官が早期の利下げをけん制したことなどを受けて、年内の利下げ織り込みが一部剥落したことなどから、上昇する場面もありましたが、米国における軟調な内容の経済指標などを受けて、期間を通じてみると低下しました。ドイツ、英国の2年債利回りは米国2年債利回りに概ね連動する形で低下しました。

◎為替市況

- ・米ドル・英ポンドは対円で下落、ユーロは対円で概ね横ばいとなりました。
- ・円安が進行する中、日銀が金融政策の正常化を慎重に進めていることなどが米ドル・ユーロ・英ポンドの対円での上昇要因となった一方、主要国金利が低下し、本邦との金利差が縮小したことなどが下落要因となりました。結果、期間を通じてみると、米ドル・英ポンドは対円で下落、ユーロは対円で概ね横ばいとなりました。

●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・スウェーデンクローネ・ノルウェークローネ・ポーランドズロチはベンチマーク比概ね多めとし、ユーロ・英ポンド・中国元を少なめとしました。また、カナダドルを中立から多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)

期間を通じて、ポーランドズロチをベンチマーク比多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)

2024年6月以降、ノルウェークローネやメキシコペソをベンチマーク比多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、ベンチマーク比スウェーデン・クロネ・ノルウェークローネなどを多め、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

(2024年2月14日～2024年8月13日)

項 目	第233期～第238期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 3	% 0.017	(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 信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保 管 費 用)	(3)	(0.017)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	3	0.017	
作成期中の平均基準価額は、20,019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

(2024年2月14日～2024年8月13日)

公社債

			第233期～第238期	
			買付額	売付額
外	アメリカ	国債証券	千アメリカドル 6,823	千アメリカドル 8,777
	カナダ	国債証券	千カナダドル -	千カナダドル 293
	メキシコ	特殊債券	千メキシコペソ 3,625	千メキシコペソ -
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	スペイン	国債証券	479	1,626
	アイルランド	国債証券	-	834
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 970	千イギリスポンド 914
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローネ 3,833	千スウェーデンクローネ 2,877
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 9,406	千ノルウェークローネ 97
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 3,119	千ポーランドズロチ -
国	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 923	千オーストラリアドル -
	中国	国債証券	千中国元 6,115	千中国元 2,009

(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

(2024年2月14日～2024年8月13日)

利害関係人との取引状況

区 分	第233期～第238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 1,019	百万円 -	% -	百万円 1,180	百万円 31	% 2.6

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

(2024年8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238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
	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	15,800	15,701	2,313,486	55.3	—	—	38.6	16.7
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	800	771	82,676	2.0	—	—	1.5	0.5
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	9,000	8,347	64,558	1.5	—	—	—	1.5
	千ユーロ	千ユーロ						
ユーロ								
スペイン	2,600	2,570	413,998	9.9	—	—	4.1	5.8
アイルランド	400	386	62,189	1.5	—	—	0.4	1.1
国際機関	1,000	1,019	164,130	3.9	—	—	—	3.9
	千イギリスポンド	千イギリスポンド						
イギリス	650	636	119,657	2.9	—	—	1.8	1.1
	千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ						
スウェーデン	6,700	6,599	92,388	2.2	—	—	1.1	1.1
	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ						
ノルウェー	10,000	9,687	132,042	3.2	—	—	—	3.2
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	4,700	4,258	159,240	3.8	—	—	3.8	—
	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル						
オーストラリア	1,150	1,075	104,317	2.5	—	—	2.5	—
	千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル						
ニュージーランド	150	147	13,128	0.3	—	—	—	0.3
	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シンガポール	150	148	16,468	0.4	—	—	—	0.4
	千中国元	千中国元						
中国	14,000	14,295	293,485	7.0	—	—	7.0	—
	千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル						
イスラエル	100	99	3,866	0.1	—	—	—	0.1
合 計	—	—	4,035,636	96.4	—	—	60.8	35.6

(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238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	1,000	978	144,134	2025/12/31	
	3 T-NOTE 250715	3.0	1,800	1,775	261,561	2025/7/15	
	3.25 T-NOTE 270630	3.25	5,000	4,920	725,002	2027/6/30	
	4 T-NOTE 280630	4.0	2,000	2,015	297,005	2028/6/30	
	4.375 T-NOTE 260815	4.375	4,000	4,028	593,526	2026/8/15	
特殊債券	3.625 INTL FINAN 250915	3.625	2,000	1,983	292,256	2025/9/15	
小計					2,313,486		
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	572	61,388	2027/3/1	
	3 CAN GOVT 251001	3.0	200	198	21,287	2025/10/1	
小計					82,676		
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	9,000	8,347	64,558	2026/1/22	
小計					64,558		
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	1,100	1,068	172,097	2027/4/30
		2.8 SPAIN GOVT 260531	2.8	1,500	1,502	241,901	2026/5/31
アイルランド	国債証券	0.2 IRISH GOVT 270515	0.2	100	94	15,158	2027/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	300	292	47,031	2026/5/15
国際機関	特殊債券	4.5 EIB 251015	4.5	1,000	1,019	164,130	2025/10/15
小計					640,318		
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券	1.5 GILT 260722	1.5	250	238	44,950	2026/7/22	
	3.75 GILT 270307	3.75	400	397	74,706	2027/3/7	
小計					119,657		
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	1,444	20,224	2028/5/12	
	1 SWD GOVT 261112	1.0	2,000	1,959	27,435	2026/11/12	
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	3,200	3,194	44,727	2025/5/12	
小計					92,388		
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	10,000	9,687	132,042	2026/2/19	
小計					132,042		
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	4,700	4,258	159,240	2026/10/25	
小計					159,240		
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	1,150	1,075	104,317	2026/9/21	
小計					104,317		
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	147	13,128	2025/4/15	
小計					13,128		

銘	柄	第238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	
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	148	16,468	2026/6/1
小	計				16,468	
中国			千中国元	千中国元		
	国債証券 2.39 CHINA GOVT 261115	2.39	4,000	4,059	83,342	2026/11/15
	2.48 CHINA GOVT 270415	2.48	5,000	5,096	104,626	2027/4/15
	2.64 CHINA GOVT 280115	2.64	5,000	5,139	105,517	2028/1/15
小	計				293,485	
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	99	3,866	2025/8/31
小	計				3,866	
合	計				4,035,636	

(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8月13日現在)

項 目	第238期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	4,035,636	96.4
コール・ローン等、その他	152,103	3.6
投資信託財産総額	4,187,739	100.0

(注) 作成期末における外貨建純資産 (4,177,646千円) の投資信託財産総額 (4,187,739千円) 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=147.34円	1 カナダドル=107.19円	1 メキシコペソ=7.7334円	1 ユーロ=161.04円
1 イギリスポンド=188.09円	1 スウェーデンクローネ=14.00円	1 ノルウェークローネ=13.63円	1 ポーランドズロチ=37.3936円
1 オーストラリアドル=96.95円	1 ニュージーランドドル=88.76円	1 シンガポールドル=111.26円	1 中国元=20.53円
1 イスラエルシェケル=38.8994円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第233期末	第234期末	第235期末	第236期末	第237期末	第238期末
	2024年3月11日現在	2024年4月10日現在	2024年5月10日現在	2024年6月10日現在	2024年7月10日現在	2024年8月13日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	4,249,102,404	4,336,649,563	4,490,666,587	4,414,033,595	4,566,402,818	4,187,739,486
コール・ローン等	85,600,652	71,770,488	39,269,328	102,269,378	190,374,610	111,195,200
公社債(評価額)	4,113,246,517	4,224,172,460	4,289,763,335	4,191,335,756	4,335,843,469	4,035,636,367
未収入金	14,677,700	—	114,010,320	75,763,459	—	—
未収利息	28,459,912	32,493,866	40,401,993	40,919,265	36,617,340	36,128,983
前払費用	7,117,623	8,212,749	7,221,611	3,745,737	3,567,399	4,778,936
(B) 負債	28,343,262	886,740	89,695,965	2,017,085	1,054,666	1,662,432
未払金	14,677,420	—	86,511,173	—	—	—
未払解約金	13,665,840	886,740	3,184,792	2,017,085	1,054,666	1,662,432
未払利息	2	—	—	—	—	—
(C) 純資産総額(A-B)	4,220,759,142	4,335,762,823	4,400,970,622	4,412,016,510	4,565,348,152	4,186,077,054
元本	2,211,061,433	2,203,775,803	2,183,640,218	2,170,282,590	2,162,270,278	2,146,946,502
次期繰越損益金	2,009,697,709	2,131,987,020	2,217,330,404	2,241,733,920	2,403,077,874	2,039,130,552
(D) 受益権総口数	2,211,061,433口	2,203,775,803口	2,183,640,218口	2,170,282,590口	2,162,270,278口	2,146,946,502口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,089円	19,674円	20,154円	20,329円	21,114円	19,498円

○損益の状況

項 目	第233期	第234期	第235期	第236期	第237期	第238期
	2024年2月14日～ 2024年3月11日	2024年3月12日～ 2024年4月10日	2024年4月11日～ 2024年5月10日	2024年5月11日～ 2024年6月10日	2024年6月11日～ 2024年7月10日	2024年7月11日～ 2024年8月13日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	9,556,384	10,904,028	11,293,099	11,520,291	10,588,721	11,440,208
受取利息	9,556,430	10,904,041	11,293,099	11,520,291	10,588,721	11,440,208
支払利息	△ 46	△ 13	—	—	—	—
(B) 有価証券売買損益	△ 51,927,749	118,519,277	93,919,310	26,582,061	159,532,092	△ 360,199,860
売買益	4,787,041	134,147,944	98,420,783	40,299,354	160,065,284	42,964,928
売買損	△ 56,714,790	△ 15,628,667	△ 4,501,473	△ 13,717,293	△ 533,192	△ 403,164,788
(C) 保管費用等	△ 107,723	△ 216,385	△ 117,286	△ 104,625	△ 101,190	△ 98,197
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 42,479,088	129,206,920	105,095,123	37,997,727	170,019,623	△ 348,857,849
(E) 前期繰越損益金	2,067,691,857	2,009,697,709	2,131,987,020	2,217,330,404	2,241,733,920	2,403,077,874
(F) 追加信託差損益金	9,116,320	2,009,778	1,522,140	11,445,865	5,111,683	2,745,331
(G) 解約差損益金	△ 24,631,380	△ 8,927,387	△ 21,273,879	△ 25,040,076	△ 13,787,352	△ 17,834,804
(H) 計(D+E+F+G)	2,009,697,709	2,131,987,020	2,217,330,404	2,241,733,920	2,403,077,874	2,039,130,552
次期繰越損益金(H)	2,009,697,709	2,131,987,020	2,217,330,404	2,241,733,920	2,403,077,874	2,039,130,552

(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 2,227,876,140円
 作成期中追加設定元本額 31,805,208円
 作成期中一部解約元本額 112,734,846円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末1.9498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 2,146,946,502円