

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年6月24日提出
【発行者名】	三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松田 通
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目１２番１号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【電話番号】	03-6250-4740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	１兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

三菱ＵＦＪ ＤＣ バランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）（「ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記の「（１１）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

１兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

（注）基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。

なお、便宜上１万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

販売会社が定める単位

申込単位は販売会社にご確認ください。

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては、１円以上１円単位とします。

（７）【申込期間】

2020年 6月25日から2021年 6月24日まで

申込期間は、前記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新される予定です。

（８）【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社によっては、確定拠出年金制度を利用する場合の申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認ください。

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：営業日の9:00～17:00）

（ ９ ）【払込期日】

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

（ １ ０ ）【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

（ １ １ ）【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

（ １ ２ ）【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の成長と収益の確保をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、5,000億円です。

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

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

商品分類表

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

属性区分表

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

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

ます。

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

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

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われのないファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。
	MRF（マネー・リザーブ・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMRFをいいます。
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	特殊型	信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。

	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（ＢＢ格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（ＢＢ格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。	
		その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。	
決算頻度	年１回	信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年２回	信託約款において、年２回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年４回	信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年６回（隔月）	信託約款において、年６回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年12回（毎月）	信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。	
	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。	
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。	
投資対象地域	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。	
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。	
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。	
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。	
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。	
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。	
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。	
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。	
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。	

	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第２条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対 象 イ ン デックス	日経２２５	信託約款において、日経２２５に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	ＴＯＰＩＸ	信託約款において、ＴＯＰＩＸに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型／絶対収益追求型	信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

〔ファンドの目的・特色〕

ファンドの目的

日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産を実質的な主要投資対象とし、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざします。

ファンドの特色

投資対象

ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、国内および先進国の株式、債券および短期金融資産に実質的な投資を行います。

- 国内、先進国の株式・債券および短期公社債等に投資するファンドです。
- 国内株式、先進国株式の組入比率を抑えて、比較的安定的な基準価額の上昇をめざすファンドです。

＜ファンドが投資対象とするマザーファンドと運用目標＞

各マザーファンド	主要投資対象	運用目標
TOPIXマザーファンド	国内株式	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
外国株式インデックスマザーファンド	先進国株式 (国内株式を除く)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
日本債券インデックスマザーファンド ^(注)	国内債券	NOMURA-BPI総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。
国内債券インデックスマザーファンド	国内債券	NOMURA-BPI総合に連動する投資成果をめざして運用を行います。
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	先進国債券 (国内債券を除く)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
マネー・マーケット・マザーファンド	国内の 短期公社債等	安定した収益の確保をめざして安定運用を行います。

(注)日本債券インデックスマザーファンドは、国内債券インデックスマザーファンドへの入れ替えに伴い、2020年12月25日に投資対象から削除する予定です。

■運用方法・運用プロセス

＜(ご参考)組入比率変更のイメージ＞



！ 上図はファンドの組入比率の変更をご理解いただくために、組入比率の変更をイメージとして示したものです。また、各投資環境における組入比率については実際の比率と異なり、投資環境等によっては、株式の組入れを行わない場合があります。

- 各資産の組入比率は以下の範囲で決定します。

<各資産の組入比率>

国内株式	0.0%～22.0%
先進国株式	0.0%～22.0%
国内債券	0.0%～51.0%
先進国債券	0.0%～25.0% (原則、25.0%固定とします。)

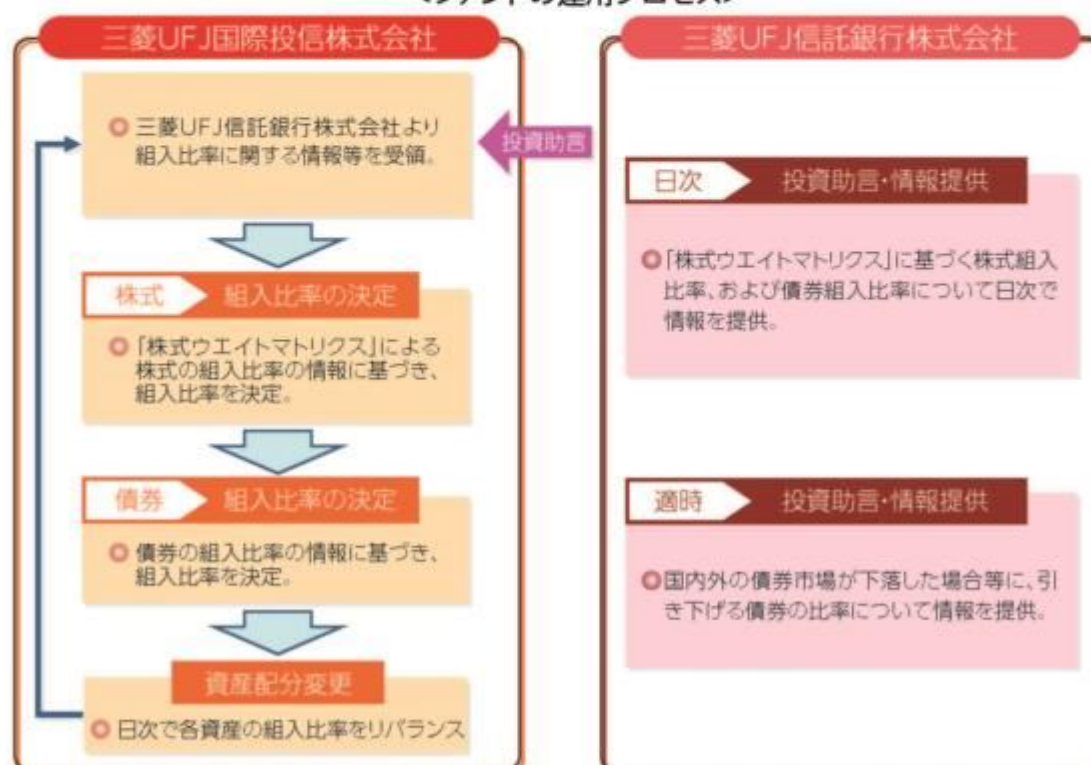
- ❗ 上記以外に短期金融資産を組み入れます。
- ❗ 上記組入比率は、今後、変更となる場合があります。

- 三菱UFJ信託銀行株式会社の投資助言・情報提供に基づき、三菱UFJ国際投信株式会社がファンドの運用を行います。

❗ 投資助言者、投資助言の内容、投資助言の有無等については、変更する場合があります。

- ファンドの運用プロセスは以下のとおりです。

<ファンドの運用プロセス>



❗ 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用を行わない場合があります。

・ファンドは、年金運用に実績のある三菱UFJ信託銀行株式会社による助言をもとに運営します。なお、ファンドのベースとなっている「下方リスク抑制」バランスは、内外株式下落による損失回避と中期的な収益確保をめざし、機動的に投資比率をコントロールする運用商品であり、三菱UFJ信託銀行株式会社が三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC)のサポートを受け、独自に開発したモデルに基づく運用手法で年金顧客向けに提供されております。

- 株式の組入比率については、投資環境や株式部分の収益寄与に基づいて決定する「株式ウェイトマトリクス」を活用します。
- ◆ 「投資環境」は、株式市場や景気の方角性、信用リスクに対する市場の反応の大きさ、株式市場の値動きの大きさ等を測る複数の指標を用いて計算される相場局面判断インデックスをもとに判断します。
- ◆ 「株式部分の収益寄与」は、過去の株式の収益率に組入比率を勘案して算出します。
- ❗ 「株式ウェイトマトリクス」は、各資産（国内株式、先進国株式）ごとに異なります。また、「投資環境」を判断する各指標については、今後変更になる場合があります。

<株式ウェイトマトリクスのイメージ>



❗ 上記の株式ウェイトマトリクスはイメージであり、実際の運用に用いるものとは異なる場合があります。

- 株式部分以外への投資については、先進国債券に一定の比率で投資を行い、残りは国内債券等に投資します。
- なお、国内外の債券市場が下落した場合等に債券の組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等への投資を行う場合があります。

📄 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ (<https://www.am.mufig.jp/corp/operation/fm.html>) でご覧いただけます。

為替対応
方針

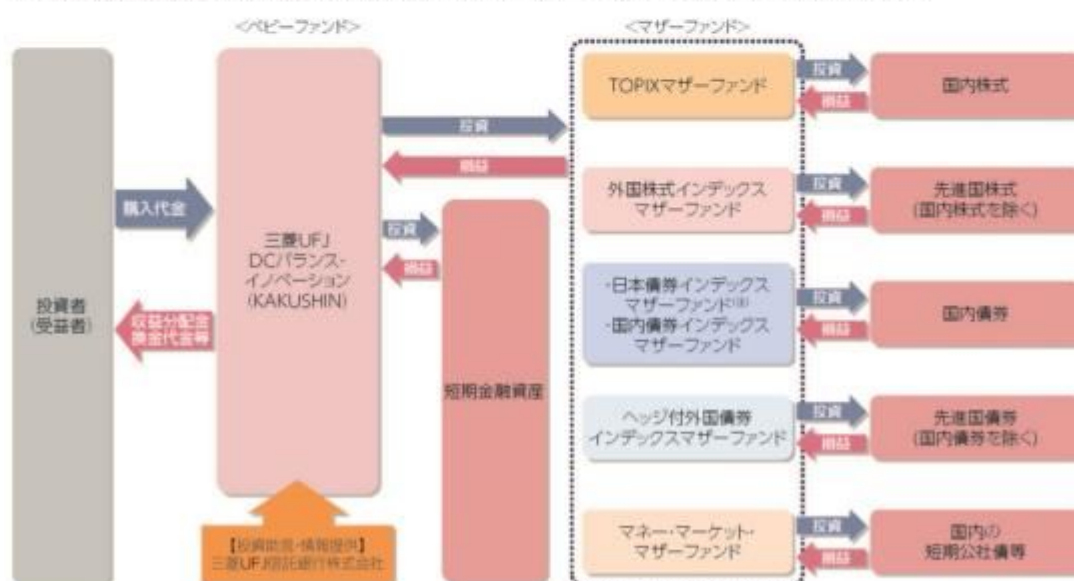
実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

- 実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。
- その他の実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行わないため、ファンドは為替相場の変動による影響を受けます。

■ 為替ヘッジを行うにあたっては、対象通貨間の金利差に基づくヘッジコストがかかります。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。

■ ファンドの仕組み

運用は主に各マザーファンド等への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および国内の短期金融資産へ実質的に投資するファミリーファンド方式により行います。



(注) 日本債券インデックスマザーファンドは、国内債券インデックスマザーファンドへの入れ替えに伴い、2020年12月25日に投資対象から削除する予定です。

分配方針

年1回の決算時(3月25日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。

- 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■主な投資制限

株式	株式への実質投資割合に制限を設けません。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
デリバティブ	デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。



指数について

・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

・MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。

MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

・NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

・FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2)【ファンドの沿革】

2014年5月30日

設定日、信託契約締結、運用開始

2020年6月25日

ファンドの投資対象に「国内債券インデックスマザーファンド」を追加

(3) 【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割

投資家（受益者）

お申込金 ↓ ↑ 収益分配金、解約代金等

販売会社	募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。
------	--

お申込金 ↓ ↑ 収益分配金、解約代金等

受託会社（受託者） 三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）	委託会社（委託者） 三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
信託財産の保管・管理等を行います。	信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。

投資 ↓ ↑ 損益

マザーファンド

投資 ↓ ↑ 損益

有価証券等

委託会社と関係法人との契約の概要

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

委託会社の概況（2020年3月末現在）

- 金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- 設立年月日
1985年8月1日
- 資本金
2,000百万円
- 沿革
 - 1997年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
 - 2004年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
 - 2005年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ投信株式会社に変更
 - 2015年7月 三菱ＵＦＪ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社に変更
- 大株主の状況

株 主 名	住 所	所有株式数	所有比率
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	211,581株	100.0%

2【投資方針】

（１）【投資方針】

ＴＯＰＩＸマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券およびマネー・マーケット・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

ＴＯＰＩＸマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざします。

株式の実質組入比率は、株式組入れを比較的抑えつつ、相場の局面判断や株式の収益率等に基づいて決定します。

債券の実質組入比率は、原則として、先進国債券を一定の比率とし、残りの部分は国内債券等を組入れます。

国内外の債券市場が下落した場合等に債券の実質組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等の組入れを行う場合があります。

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な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。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（注）日本債券インデックスマザーファンドは、国内債券インデックスマザーファンドへの入れ替えに伴い、2020年12月25日に投資対象から削除する予定です。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

１．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、信託約款に定める次のものに限ります。）

ａ．有価証券先物取引等

ｂ．スワップ取引

ｃ．金利先渡取引および為替先渡取引

ハ．約束手形

ニ．金銭債権

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、三菱ＵＦＪ国際投信株式会社を委託会社とし、三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社を受託会社とするＴＯＰＩＸマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンド、日本債券インデックスマザーファンド、国内債券インデックスマザーファンド、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドおよびマネー・マーケット・マザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

１．株券または新株引受権証書

2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
 11. コマーシャル・ペーパー
 12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から12. の証券または証書の性質を有するもの
 14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16. において同じ。）で16. で定めるものの以外のもの
 16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16. において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 21. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 22. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 24. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいい、1. から23. に該当するものを除きます。）
 25. 外国の者に対する権利で23. および24. の有価証券の性質を有するもの
- なお、1. の証券または証書ならびに13. および19. の証券または証書のうち1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から6. までの証券ならびに16. の証券ならびに13. および19. の証券または証書のうち2. から6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14. および15. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

この信託において投資の対象とする金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）は、次に掲げるものとします。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 信託の受益権（金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、1. から5. に該当するものを除きます。）

- ７．投資事業有限責任組合契約に基づく権利（金融商品取引法第２条第２項第５号に該当するものをいいます。）
- ８．外国の者に対する権利で５．から７．の権利の性質を有するものその他の投資対象
- 信託約款に定める次に掲げるもの。
- ・外国為替予約取引

<マザーファンドの概要>

ＴＯＰＩＸマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）と連動する投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資態度

主として対象インデックスに採用されている株式に投資を行い、信託財産の１口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。

対象インデックスからカイ離するリスクと運用コストの極小化を目的として、定量的なリスク管理に基づいたポートフォリオ構築と適切な売買執行を行います。

株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます。）は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国株式インデックスマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式を主要投資対象とします。

投資態度

主として対象インデックスに採用されている株式に投資を行い、信託財産の１口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。

投資成果を対象インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

- ・株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、ま

たは株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。

・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

外国為替予約取引を行うことができます。

デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

日本債券インデックスマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、NOMURA - BPI総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

NOMURA - BPI総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。

投資態度

主として対象インデックスに採用されている公社債に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。投資成果を対象インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

・公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。

・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

国内債券インデックスマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、NOMURA - BPI総合に連動する投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

主としてわが国の公社債に投資を行います。

公社債の組入比率は高位を維持することを基本とします。

対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の実質投資比率が100%を超える場合があります。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・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。

対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の投資比率が100%を超える場合があります。

組入外貨建資産については、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、為替ヘッジ比率を引き下げる、あるいは為替ヘッジ比率を100%以上に引き上げる運用指図を行う場合があります。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の１０％以下とします。

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

マネー・マーケット・マザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、安定した収益の確保をめざして安定運用を行います。

（運用方法）

投資対象

わが国の公社債等を主要投資対象とします。

投資態度

わが国の短期公社債等を中心に投資し、利子等収益の確保を図ります。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

株式への投資は行いません。

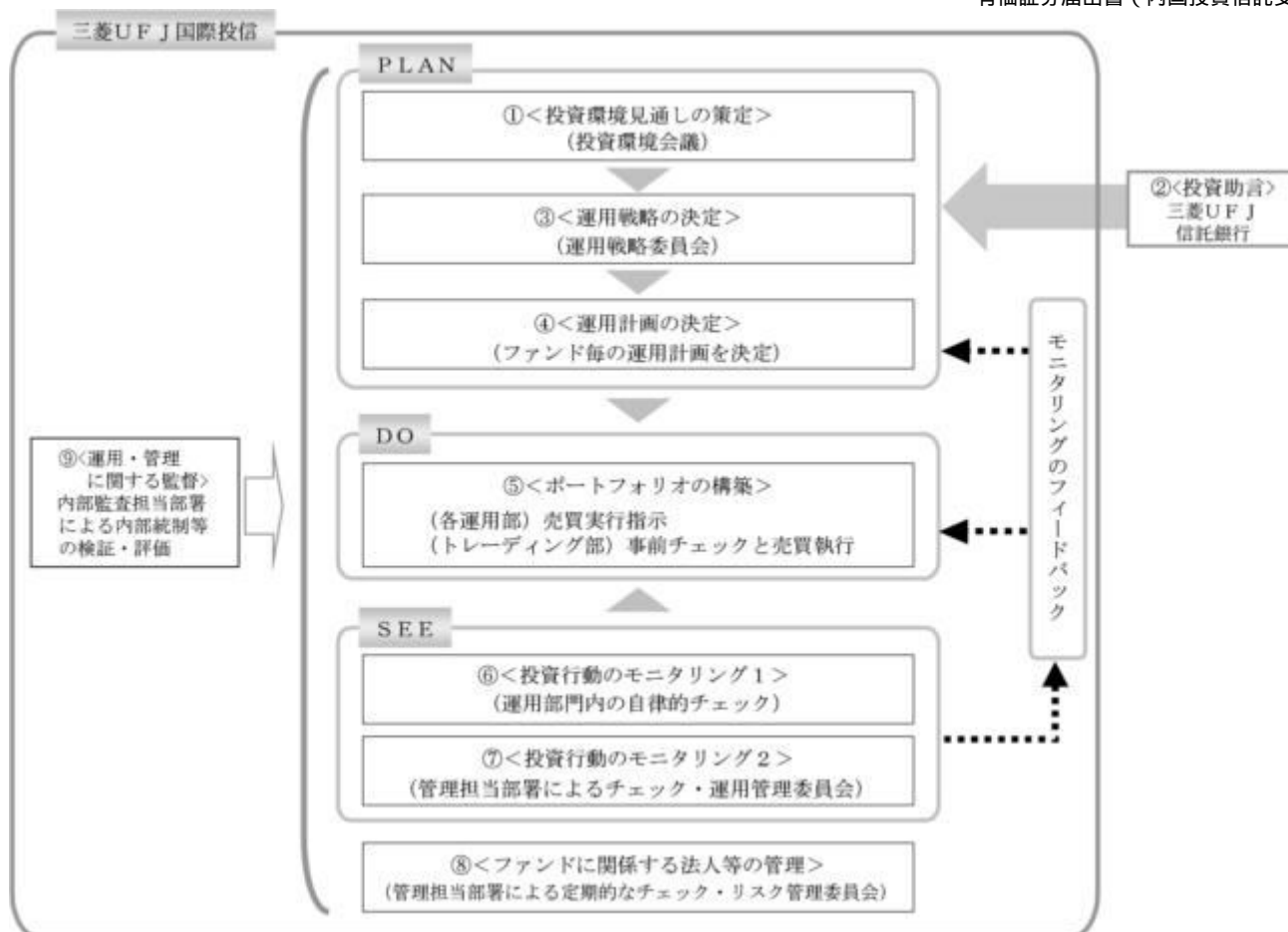
外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

金利先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

（３）【運用体制】



投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

投資助言

当ファンドは、三菱ＵＦＪ信託銀行（「助言元」といいます。）から運用戦略または運用計画の立案に資する投資助言を受けています。

運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通し、およびの投資助言に沿って運用戦略を決定します。

運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

投資行動のモニタリング１

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

投資行動のモニタリング２

運用部から独立した管理担当部署（４０～６０名程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

ファンドに関係する法人等の管理

助言元、受託会社等、ファンドの運営に関係する法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（１０名程度）は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健

全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

なお、委託会社に関する「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページでご覧いただけます。

「運用担当者に係る事項」 <https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。

収益の分配にあてなかった利益については、信託約款に定める運用の基本方針に基づいて運用を行います。

（５）【投資制限】

< 信託約款に定められた投資制限 >

新株引受権証券および新株予約権証券

a．委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

投資信託証券

a．委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券（金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券をいいます。）を除きます。以下a．およびb．において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

同一銘柄の転換社債等

a．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債（新株予約権付社債のうち、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

スワップ取引

a．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「ス

ワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

信用取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- b. a. の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券により取得する株券
 - 2. 株式分割により取得する株券
 - 3. 有償増資により取得する株券
 - 4. 売出しにより取得する株券
 - 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
 - 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債の新株予約権（5. に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

外国為替予約取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- b. a. の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- c. b. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- d. b. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

有価証券の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. a. の指図は、当該借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約

代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

- c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

投資する株式等の範囲

- a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。
- b. a. の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができます。

金利先渡取引および為替先渡取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- b. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

有価証券の貸付

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. a. に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

有価証券の空売り

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または の規定により借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- b. a. の売付けの指図は、当該売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制限されることがあります。

デリバティブ取引等

デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。）については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。

信用リスクの分散規制

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

<その他法令等に定められた投資制限>

- ・同一の法人の発行する株式への投資制限

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

（１）投資リスク

ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けますが、これらの運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

（主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。）

価格変動リスク

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動し、また、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株式や公社債の価格が下落した場合には基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

為替変動リスク

組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。しかし、為替ヘッジにより、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。そのため、為替相場の変動によっては、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

なお、為替ヘッジを行う場合で円金利がヘッジ対象通貨建の金利より低いときには、これらの金利差相当分がヘッジコストとなります。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。

その他の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ので、為替変動の影響を大きく受けます。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、投資元本を割り込むことがあります。

信用リスク

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、投資元本を割り込むことがあります。

流動性リスク

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、組み入れている株式や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、投資元本を割り込むことがあります。

留意事項

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが見込まれた場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- ・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。

（２）投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っています。また、定期的開催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。この内容は運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

トレーディング担当部署

有価証券等の売買執行および発注に係る法令等の遵守および監視・牽制を行います。

コンプライアンス担当部署

法令上の禁止行為、約款の投資制限等のモニタリングを通じ、法令等遵守状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

リスク管理担当部署

運用リスク全般の状況をモニタリング・管理するとともに、運用実績の分析および評価を行い、必要に応じて改善策等を提言します。また、事務・情報資産・その他のリスクの統括的管理を行っています。

内部監査担当部署

委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

<流動性リスクに対する管理体制>

流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立したリスク管理担当部署においても流動性についての情報収集や分析・管理を行い、この結果はリスク管理に関する会議体等に報告されます。

* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

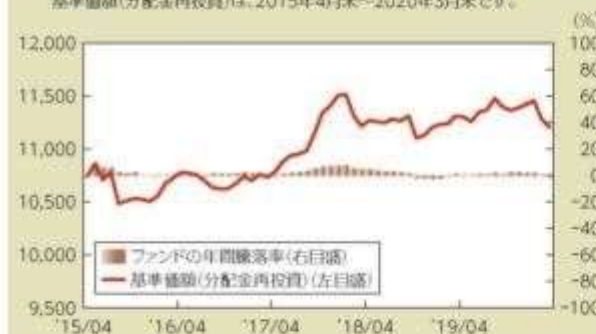
■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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

● ファンドの年間騰落率および基準価額（分配金再投資）の推移

ファンドの年間騰落率は、2015年5月～2020年3月です。

基準価額（分配金再投資）は、2015年4月末～2020年3月末です。



● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2015年4月末～2020年3月末)

ファンドの年間騰落率は、2015年5月～2020年3月です。



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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み)	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI (国債)	NOMURA-BPI (国債)とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な国債パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI (総合)のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本)	FTSE世界国債インデックス (除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当該指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

申込手数料の対価として提供する役務の内容は、ファンドおよび投資環境の説明・情報提供、購入に関する事務手続等です。

（２）【換金（解約）手数料】

かかりません。

換金（解約）手数料の対価として提供する役務の内容は、商品の換金に関する事務手続等です。

（３）【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年0.66%（税抜0.6%）の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

1万口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額×信託報酬率×（保有日数／365）

上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

- ・信託報酬は、毎計算期間の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。
- ・信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.4%	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
販売会社	0.17%	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
受託会社	0.03%	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

上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

（４）【その他の手数料等】

- ・信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外国株式インデックスマザーファンドの解約に伴う信託財産留保額、受託会社の立替えた立替金の利息、借入を行う場合の借入金の利息および借入れに関する品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ・信託財産に係る監査費用（消費税等相当額を含みます。）は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁します。支弁時期は信託報酬と同様です。
- ・信託財産（投資している投資信託を含みます。）の組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等（消費税等相当額を含みます。）、先物取引・オプション取引等に要する費用および外貨建資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担するものとします。

売買条件等により異なるため、あらかじめ金額または上限額等を記載することはできません。

（注）手数料等については、保有金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等を記載することはできません。なお、ファンドが負担する費用（手数料等）の支払い実績は、交付運用報告書に開示されていますのでご参照ください。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の譲渡益については、次の通り課税されます。

１．収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されませ

ん。

原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません。）・申告分離課税を選択することもできます。

2. 解約時および償還時の課税

解約価額および償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得とみなされて課税されます。

20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

解約時および償還時の損失（譲渡損）については、確定申告により収益分配金を含む上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）との損益通算が可能となる仕組みがあります。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

- （＊）確定拠出年金法に定める加入者等の運用の指図に基づいて受益権の取得の申込みを行う資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

個別元本について

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となり

ます。

上記は2020年3月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

【三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）】

（１）【投資状況】

令和 2年 3月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	6,748,470,141	76.13
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	2,116,113,325	23.87
純資産総額		8,864,583,466	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位 30 銘柄

令和 2年 3月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	3,340,978,210	1.3512	4,514,336,417	1.3513	4,514,663,855	50.93
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	1,598,544,645	1.3840	2,212,443,396	1.3974	2,233,806,286	25.20

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 2年 3月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	76.13
合計	76.13

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和2年3月末日、同日前１年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

	純資産総額		基準価額 （１万口当たりの純資産価額）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間末日（平成27年 3月25日）	35,553,059	35,553,059	10,752	10,752
第2計算期間末日（平成28年 3月25日）	807,612,280	807,612,280	10,742	10,742
第3計算期間末日（平成29年 3月27日）	1,403,572,405	1,403,572,405	10,697	10,697
第4計算期間末日（平成30年 3月26日）	2,639,151,920	2,639,151,920	11,120	11,120
第5計算期間末日（平成31年 3月25日）	6,301,738,329	6,301,738,329	11,294	11,294
第6計算期間末日（令和 2年 3月25日）	8,770,011,322	8,770,011,322	11,178	11,178
平成31年 3月末日	6,357,870,550	—	11,310	—
4月末日	6,429,118,058	—	11,302	—
令和 1年 5月末日	6,795,501,634	—	11,258	—
6月末日	7,075,458,279	—	11,348	—
7月末日	7,217,554,504	—	11,368	—
8月末日	7,424,258,587	—	11,476	—
9月末日	7,545,646,892	—	11,397	—
10月末日	7,808,003,641	—	11,363	—
11月末日	8,054,818,824	—	11,387	—
12月末日	8,276,172,629	—	11,420	—
令和 2年 1月末日	8,595,016,101	—	11,456	—
2月末日	8,623,124,466	—	11,277	—
3月末日	8,864,583,466	—	11,204	—

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	0円
第2計算期間	0円
第3計算期間	0円
第4計算期間	0円

第5計算期間	0円
第6計算期間	0円

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	7.52
第2計算期間	0.09
第3計算期間	0.41
第4計算期間	3.95
第5計算期間	1.56
第6計算期間	1.02

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	34,064,041	997,459	33,066,582
第2計算期間	897,344,061	178,600,159	751,810,484
第3計算期間	815,850,058	255,563,488	1,312,097,054
第4計算期間	1,435,863,542	374,521,457	2,373,439,139
第5計算期間	3,809,862,810	603,687,552	5,579,614,397
第6計算期間	3,243,919,150	977,723,872	7,845,809,675

（参考）

日本債券インデックスマザーファンド

投資状況

令和 2年 3月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	日本	490,933,048,120	84.00
地方債証券	日本	30,069,671,538	5.14
特殊債券	日本	35,811,303,568	6.13
社債券	日本	26,257,373,500	4.49
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	1,400,620,080	0.24
純資産総額		584,472,016,806	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

令和 2年 3月31日現在
（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
債券先物取引	買建	日本	610,280,000	0.10

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 3 0 銘柄

令和 2年 3月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (％)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (％)
日本	国債証券	第 4 0 8 回利付国債（ 2 年）	9,550,000,000	100.51	9,599,337,000	100.42	9,590,205,500	0.100000	2022/1/1	1.64
日本	国債証券	第 3 4 2 回利付国債（ 1 0 年）	8,240,000,000	102.43	8,440,232,000	101.35	8,351,404,800	0.100000	2026/3/20	1.43
日本	国債証券	第 1 3 4 回利付国債（ 5 年）	8,060,000,000	101.05	8,145,388,500	100.68	8,114,969,200	0.100000	2022/12/20	1.39
日本	国債証券	第 3 3 9 回利付国債（ 1 0 年）	6,660,000,000	103.37	6,884,773,200	102.78	6,845,481,000	0.400000	2025/6/20	1.17
日本	国債証券	第 3 3 3 回利付国債（ 1 0 年）	6,550,000,000	103.73	6,794,904,500	102.86	6,737,919,500	0.600000	2024/3/20	1.15
日本	国債証券	第 1 3 7 回利付国債（ 5 年）	6,000,000,000	101.20	6,072,000,000	100.80	6,048,120,000	0.100000	2023/9/20	1.03
日本	国債証券	第 3 2 9 回利付国債（ 1 0 年）	5,860,000,000	103.98	6,093,462,400	103.00	6,036,151,600	0.800000	2023/6/20	1.03
日本	国債証券	第 3 4 8 回利付国債（ 1 0 年）	5,700,000,000	101.96	5,811,720,000	101.81	5,803,284,000	0.100000	2027/9/20	0.99
日本	国債証券	第 3 5 4 回利付国債（ 1 0 年）	5,690,000,000	101.89	5,797,627,000	101.25	5,761,637,100	0.100000	2029/3/20	0.99
日本	国債証券	第 3 4 4 回利付国債（ 1 0 年）	5,510,000,000	101.96	5,618,292,000	101.50	5,592,705,100	0.100000	2026/9/20	0.96
日本	国債証券	第 3 5 1 回利付国債（ 1 0 年）	5,410,000,000	101.76	5,505,539,600	101.57	5,495,099,300	0.100000	2028/6/20	0.94
日本	国債証券	第 3 5 5 回利付国債（ 1 0 年）	5,350,000,000	102.86	5,503,010,000	101.15	5,411,792,500	0.100000	2029/6/20	0.93
日本	国債証券	第 1 4 2 回利付国債（ 5 年）	5,220,000,000	101.67	5,307,402,000	101.02	5,273,244,000	0.100000	2024/12/20	0.90
日本	国債証券	第 1 3 8 回利付国債（ 5 年）	5,150,000,000	101.49	5,227,035,000	100.82	5,192,333,000	0.100000	2023/12/20	0.89
日本	国債証券	第 3 3 2 回利付国債（ 1 0 年）	5,040,000,000	103.54	5,218,819,200	102.69	5,175,576,000	0.600000	2023/12/20	0.89
日本	国債証券	第 3 5 0 回利付国債（ 1 0 年）	5,070,000,000	101.79	5,160,753,000	101.64	5,153,502,900	0.100000	2028/3/20	0.88
日本	国債証券	第 1 3 1 回利付国債（ 5 年）	5,010,000,000	100.79	5,049,759,800	100.47	5,033,697,300	0.100000	2022/3/20	0.86

日本	国債証券	第３４７回利付国債（１０年）	4,920,000,000	102.20	5,028,282,000	101.78	5,007,920,400	0.100000	2027/6/20	0.86
日本	国債証券	第３５７回利付国債（１０年）	4,950,000,000	101.87	5,042,756,200	100.87	4,993,213,500	0.100000	2029/12/20	0.85
日本	国債証券	第１３０回利付国債（５年）	4,950,000,000	100.69	4,984,254,000	100.40	4,970,047,500	0.100000	2021/12/20	0.85
日本	国債証券	第１４２回利付国債（２０年）	4,110,000,000	122.79	5,046,684,300	120.29	4,944,124,500	1.800000	2032/12/20	0.85
日本	国債証券	第３４３回利付国債（１０年）	4,710,000,000	101.46	4,778,917,000	101.41	4,776,411,000	0.100000	2026/6/20	0.82
日本	国債証券	第１４１回利付国債（５年）	4,640,000,000	101.01	4,687,267,200	100.98	4,685,843,200	0.100000	2024/9/20	0.80
日本	国債証券	第３３５回利付国債（１０年）	4,470,000,000	103.61	4,631,367,000	102.83	4,596,635,100	0.500000	2024/9/20	0.79
日本	国債証券	第３４５回利付国債（１０年）	4,440,000,000	102.22	4,538,637,000	101.59	4,510,729,200	0.100000	2026/12/20	0.77
日本	国債証券	第３３４回利付国債（１０年）	4,330,000,000	103.96	4,501,554,600	103.07	4,463,147,500	0.600000	2024/6/20	0.76
日本	国債証券	第１３３回利付国債（２０年）	3,640,000,000	121.85	4,435,596,200	119.34	4,344,267,200	1.800000	2031/12/20	0.74
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	4,090,000,000	101.72	4,160,348,000	101.49	4,150,981,900	0.100000	2028/9/20	0.71
日本	国債証券	第３５６回利付国債（１０年）	4,000,000,000	101.45	4,058,019,000	100.99	4,039,760,000	0.100000	2029/9/20	0.69
日本	国債証券	第３３６回利付国債（１０年）	3,880,000,000	103.78	4,026,664,000	102.99	3,996,089,600	0.500000	2024/12/20	0.68

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 2年 3月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	84.00
地方債証券	5.14
特殊債券	6.13
社債券	4.49
合計	99.76

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

令和 2年 3月31日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物 2 0 年 0 6 月限	買建	4	円	622,164,400	610,280,000	0.10

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

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

令和 2年 3月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国 / 地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	89,291,486,259	49.29
	フランス	16,903,496,814	9.33
	イタリア	15,424,522,690	8.51
	イギリス	11,260,442,047	6.22
	ドイツ	10,596,940,535	5.85
	スペイン	9,481,977,935	5.23
	ベルギー	4,062,560,042	2.24
	カナダ	3,169,399,585	1.75
	オランダ	3,140,241,815	1.73
	オーストラリア	3,114,452,904	1.72
	オーストリア	2,371,735,968	1.31
	メキシコ	1,194,415,796	0.66
	シンガポール	1,146,156,373	0.63
	アイルランド	1,101,526,726	0.61
	フィンランド	1,023,823,459	0.57
	ポーランド	906,768,864	0.50
	デンマーク	835,093,896	0.46
	南アフリカ	695,203,926	0.38
	スウェーデン	477,683,276	0.26
	ノルウェー	416,601,953	0.23
小計		176,614,530,863	97.48
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	4,556,593,455	2.52
純資産総額		181,171,124,318	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

令和 2年 3月31日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	1.875 T-NOTE 220228	12,500,000	10,969.72	1,371,215,488	11,228.19	1,403,524,394	1.875000	2022/2/28	0.77

アメリカ	国債証券	3.125 T-NOTE 281115	10,600,000	12,186.78	1,291,799,041	13,153.12	1,394,231,333	3.125000	2028/11/15	0.77
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 221115	12,150,000	10,953.89	1,330,897,871	11,267.73	1,369,029,321	1.625000	2022/11/15	0.76
アメリカ	国債証券	1.875 T-NOTE 220430	12,000,000	10,979.07	1,317,489,178	11,255.40	1,350,648,319	1.875000	2022/4/30	0.75
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 230115	11,000,000	10,945.25	1,203,977,583	11,255.82	1,238,141,054	1.500000	2023/1/15	0.68
アメリカ	国債証券	2.375 T-NOTE 270515	9,800,000	11,463.71	1,123,443,587	12,280.78	1,203,516,961	2.375000	2027/5/15	0.66
アメリカ	国債証券	2.375 T-NOTE 240229	10,000,000	11,263.90	1,126,390,500	11,747.68	1,174,768,836	2.375000	2024/2/29	0.65
アメリカ	国債証券	6.125 T-BOND 271115	7,500,000	14,501.59	1,087,619,812	15,417.72	1,156,329,377	6.125000	2027/11/15	0.64
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 250430	9,400,000	11,625.22	1,092,770,737	12,233.17	1,149,918,186	2.875000	2025/4/30	0.63
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280815	8,900,000	11,970.92	1,065,412,629	12,877.64	1,146,110,836	2.875000	2028/8/15	0.63
アメリカ	国債証券	2.625 T-NOTE 290215	8,800,000	11,760.44	1,034,918,885	12,733.96	1,120,588,501	2.625000	2029/2/15	0.62
アメリカ	国債証券	2.375 T-NOTE 240815	9,200,000	11,303.01	1,039,877,451	11,834.41	1,088,765,928	2.375000	2024/8/15	0.60
アメリカ	国債証券	2.5 T-NOTE 240515	9,100,000	11,338.72	1,031,824,032	11,842.91	1,077,705,229	2.500000	2024/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 260515	9,200,000	10,914.45	1,004,130,198	11,614.20	1,068,506,544	1.625000	2026/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	2.5 T-NOTE 230815	9,050,000	11,271.52	1,020,072,841	11,682.22	1,057,240,938	2.500000	2023/8/15	0.58
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 231115	8,800,000	11,392.29	1,002,521,555	11,837.81	1,041,727,562	2.750000	2023/11/15	0.57
アメリカ	国債証券	1.75 T-NOTE 220515	9,200,000	10,951.86	1,007,571,947	11,239.67	1,034,049,945	1.750000	2022/5/15	0.57
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 231231	8,800,000	11,201.83	985,761,734	11,664.36	1,026,464,154	2.250000	2023/12/31	0.57
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 260215	8,800,000	10,913.60	960,397,542	11,603.14	1,021,077,069	1.625000	2026/2/15	0.56
アメリカ	国債証券	2.625 T-NOTE 211215	9,000,000	11,110.43	999,939,392	11,329.79	1,019,681,834	2.625000	2021/12/15	0.56
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 230215	8,900,000	11,058.99	984,250,867	11,417.79	1,016,183,970	2.000000	2023/2/15	0.56
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 231031	8,500,000	11,434.80	971,958,179	11,876.92	1,009,538,538	2.875000	2023/10/31	0.56
アメリカ	国債証券	3.625 T-BOND 440215	6,200,000	14,172.45	878,692,144	16,259.88	1,008,112,696	3.625000	2044/2/15	0.56
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 220215	8,900,000	10,999.05	978,916,072	11,247.32	1,001,011,963	2.000000	2022/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	3.125 T-BOND 440815	6,600,000	12,947.36	854,526,358	15,154.57	1,000,202,115	3.125000	2044/8/15	0.55
アメリカ	国債証券	3.375 T-BOND 481115	6,000,000	13,827.36	829,641,698	16,317.69	979,061,887	3.375000	2048/11/15	0.54
アメリカ	国債証券	2.125 T-NOTE 221231	8,500,000	11,349.15	964,677,881	11,437.35	972,174,989	2.125000	2022/12/31	0.54
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 260815	8,300,000	10,825.18	898,490,276	11,553.83	958,968,298	1.500000	2026/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 270131	8,200,000	11,222.65	920,257,991	11,583.59	949,854,636	1.500000	2027/1/31	0.52
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 220815	8,400,000	10,930.18	918,135,792	11,241.37	944,275,398	1.625000	2022/8/15	0.52

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 2年 3月31日現在

種類	投資比率（％）
----	---------

国債証券	97.48
合計	97.48

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

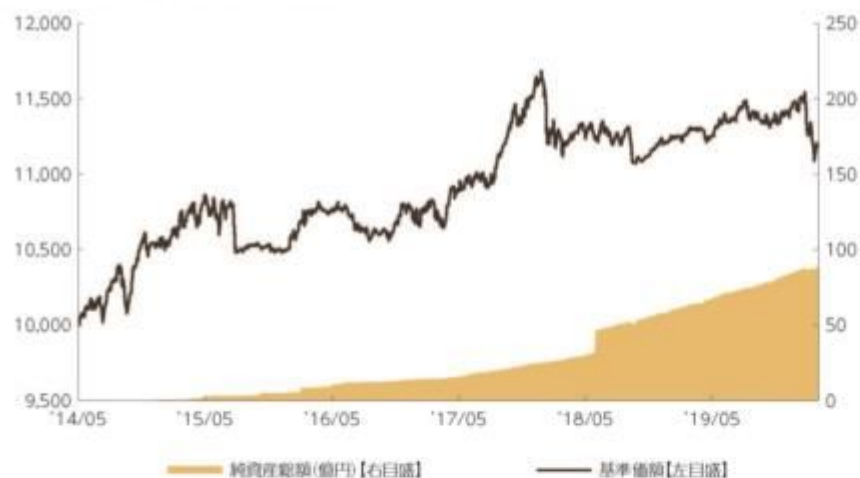
参考情報



運用実績

2020年3月31日現在

■基準価額・純資産の推移 2014年5月30日(設定日)～2020年3月31日



■基準価額・純資産

基準価額	11,204円
純資産総額	88.6億円

■分配の推移

2020年 3月	0円
2019年 3月	0円
2018年 3月	0円
2017年 3月	0円
2016年 3月	0円
2015年 3月	0円
設定来累計	0円

●分配金は1万円当たり、税引前

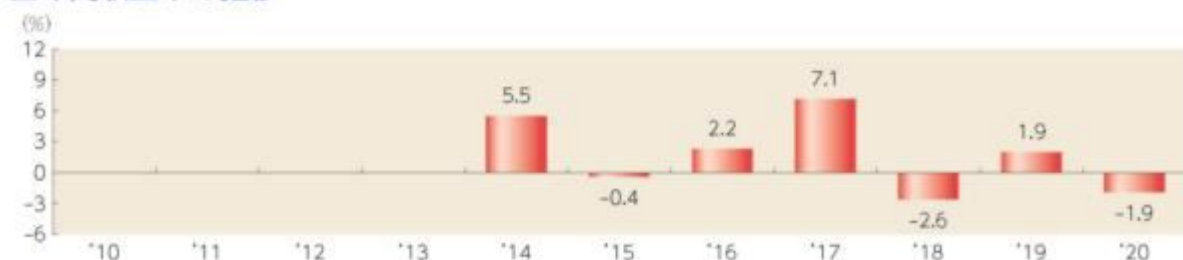
■主要な資産の状況

資産別構成	比率	組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	種類	種別	比率
国内債券	50.8%	1 円	99.7%	1 第408回利付国債(2年)	債券	国債	0.8%
外国債券	24.6%	2 アメリカドル	0.5%	2 第342回利付国債(10年)	債券	国債	0.7%
		3 イギリスポンド	0.1%	3 第134回利付国債(5年)	債券	国債	0.7%
		4 カナダドル	0.0%	4 第339回利付国債(10年)	債券	国債	0.6%
		5 ポーランドズロチ	0.0%	5 第333回利付国債(10年)	債券	国債	0.6%
		6 ノルウェーグロネ	0.0%	6 第137回利付国債(5年)	債券	国債	0.5%
		7 シンガポールドル	0.0%	7 第329回利付国債(10年)	債券	国債	0.5%
		8 スウェーデングロネ	-0.0%	8 第348回利付国債(10年)	債券	国債	0.5%
コールローン他 (負債控除後)	24.6%	9 デンマークグロネ	-0.0%	9 第354回利付国債(10年)	債券	国債	0.5%
合計	100.0%	10 オーストラリアドル	-0.0%	10 第344回利付国債(10年)	債券	国債	0.5%

その他資産の状況	比率
債券先物取引(買建)	0.1%

- 各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2014年は設定日から年末までの、2020年は年初から3月31日までの収益率を表示
- ファンドにベンチマークはありません。

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

1【申込（販売）手続等】

申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

ただし、以下の日は申込みができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

申込単位

販売会社が定める単位

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては、１円以上１円単位

申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認ください。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

申込手数料

ありません。

申込方法

取得申込者は、販売会社取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

申込受付時間

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後３時までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては上記と異なる取扱いをしている場合があります。

取得申込みの受付の中止および取消し

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことがあります。

申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

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

解約単位

販売会社が定める単位

確定拠出年金制度を利用する場合の解約請求については、1口単位

解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

信託財産留保額

ありません。

解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

支払開始日

解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して6営業日目から販売会社において支払います。

解約請求受付時間

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。

確定拠出年金制度を利用する場合の解約請求については上記と異なる取扱いをしている場合があります。

解約請求受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求を取り消すことがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとします。

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

「信託財産の純資産総額」とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

（資産の評価方法）

・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場（外国で取引されているものについては、原則として、金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場）で評価します。

・転換社債／転換社債型新株予約権付社債

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額（外国で取引されているものについては、原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額）で評価します。

・公社債等

原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額で評価します。

残存期間１年以内の公社債等については、一部償却原価法による評価を適用することができます。

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・外貨建資産

原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円換算します。

・外国為替予約取引

原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034
（受付時間：営業日の9:00～17:00）
ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限（2014年5月30日設定）
ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。

（４）【計算期間】

毎年３月26日から翌年３月25日まで
ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。
なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

ファンドの償還条件等

委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。（任意償還）

- ・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合
- ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき

このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。

委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。

信託約款の変更等

委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは受託会社を同一とする他ファンドとの併合を行うことができます。委託会社は、変更または併合しようとするときは、あらかじめその旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。

ファンドの償還等に関する開示方法

委託会社は、ファンドの任意償還（信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたとき、また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、書面決議の手続を行うことが困難な場合を除きます。）、信託約款の変更または併合（変更にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款変更等」といいます。）をしようとする場合には、書面による決議（「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに任意償還等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、受益者に対し書面をもって書面決議の通知を発します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、受益者が議決権を行行使しないときは書面決議について賛成するものとみなします。書面決議は、議決権を行行使することができる受益者の議決権

の3分の2以上をもって行います。書面決議の効力は、ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

併合に係るいずれかのファンドにおいて、書面決議が否決された場合、併合を行うことはできません。

反対受益者の受益権買取請求の不適用

委託会社がファンドの任意償還、重大な約款変更等を行う場合、書面決議において反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。この規定は、受益者が自己に帰属する受益権についてその全部または一部の償還を請求したときに、委託会社が信託約款の規定に基づいて信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じることとする場合には適用しません。

関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結された「投資信託受益権の取扱に関する契約」の契約期間は、契約締結日から1年とします。ただし双方から契約満了日の3ヵ月前までに別段の意思表示のないときは、さらに1年間延長するものとし、その後も同様とします。

運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、交付運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更、ファンドの任意償還等があった場合は、その内容を交付運用報告書に記載します。

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

信託事務の再信託

受託会社は、ファンドに係る信託事務の処理の一部について再信託受託会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.am.mufg.jp/>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に应じて受領する権利を有します。

収益分配金は、「累積投資契約」に基づいて、決算日の基準価額により自動的に無手数料で全額再投資されます。（税金が差引かれる場合があります。）

（２）償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に依りて受領する権利を有します。

償還金は、信託終了日後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（休業日の場合は翌営業日）から起算して５営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、償還金について支払開始日から１０年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

（３）換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

くわしくは「第２ 管理及び運営 ２ 換金（解約）手続等」を参照してください。

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（平成31年3月26日から令和2年3月25日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 [平成31年 3月25日現在]	第6期 [令和 2年 3月25日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,103,098,815	2,253,382,444
親投資信託受益証券	5,229,403,339	6,579,779,813
流動資産合計	6,332,502,154	8,833,162,257
資産合計	6,332,502,154	8,833,162,257
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,532,256	36,094,380
未払受託者報酬	906,056	1,344,710
未払委託者報酬	17,214,951	25,549,396
未払利息	1,890	1,145
その他未払費用	108,672	161,304
流動負債合計	30,763,825	63,150,935
負債合計	30,763,825	63,150,935
純資産の部		
元本等		
元本	5,579,614,397	7,845,809,675
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	722,123,932	924,201,647
（分配準備積立金）	92,038,227	120,622,881
元本等合計	6,301,738,329	8,770,011,322
純資産合計	6,301,738,329	8,770,011,322
負債純資産合計	6,332,502,154	8,833,162,257

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自 平成30年 3月27日 至 平成31年 3月25日	第6期 自 平成31年 3月26日 至 令和 2年 3月25日
営業収益		
受取利息	556	3,934
有価証券売買等損益	95,907,850	54,392,149
営業収益合計	95,908,406	54,388,215
営業費用		
支払利息	409,353	456,821
受託者報酬	1,537,288	2,471,667
委託者報酬	29,208,191	46,961,552
その他費用	197,873	298,750
営業費用合計	31,352,705	50,188,790
営業利益又は営業損失（ ）	64,555,701	104,577,005
経常利益又は経常損失（ ）	64,555,701	104,577,005
当期純利益又は当期純損失（ ）	64,555,701	104,577,005
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	3,638,446	4,363,020
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	265,712,781	722,123,932
剰余金増加額又は欠損金減少額	466,385,120	438,777,752
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	466,385,120	438,777,752
剰余金減少額又は欠損金増加額	70,891,224	127,760,012
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	70,891,224	127,760,012
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	722,123,932	924,201,647

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
-------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

	第5期 [平成31年 3月25日現在]	第6期 [令和 2年 3月25日現在]
１．期首元本額	2,373,439,139円	5,579,614,397円
期中追加設定元本額	3,809,862,810円	3,243,919,150円
期中一部解約元本額	603,687,552円	977,723,872円
２．受益権の総数	5,579,614,397口	7,845,809,675口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第5期 自 平成30年 3月27日 至 平成31年 3月25日	第6期 自 平成31年 3月26日 至 令和 2年 3月25日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>43,894,919円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>17,022,336円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>630,085,705円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>31,120,972円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>722,123,932円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>5,579,614,397口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>1,294円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>—円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>—円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	43,894,919円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	17,022,336円	収益調整金額	C	630,085,705円	分配準備積立金額	D	31,120,972円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	722,123,932円	当ファンドの期末残存口数	F	5,579,614,397口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,294円	1万口当たり分配金額	H	—円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	—円	<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>40,894,657円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>—円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>803,578,766円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>79,728,224円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>924,201,647円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>7,845,809,675口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>1,177円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>—円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>—円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	40,894,657円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	—円	収益調整金額	C	803,578,766円	分配準備積立金額	D	79,728,224円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	924,201,647円	当ファンドの期末残存口数	F	7,845,809,675口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,177円	1万口当たり分配金額	H	—円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	—円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	43,894,919円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	17,022,336円																																																											
収益調整金額	C	630,085,705円																																																											
分配準備積立金額	D	31,120,972円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	722,123,932円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	5,579,614,397口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,294円																																																											
1万口当たり分配金額	H	—円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	—円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	40,894,657円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	—円																																																											
収益調整金額	C	803,578,766円																																																											
分配準備積立金額	D	79,728,224円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	924,201,647円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	7,845,809,675口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,177円																																																											
1万口当たり分配金額	H	—円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	—円																																																											

（金融商品に関する注記）

１ 金融商品の状況に関する事項

区分	第5期 自 平成30年 3月27日 至 平成31年 3月25日	第6期 自 平成31年 3月26日 至 令和 2年 3月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第5期 [平成31年 3月25日現在]	第6期 [令和 2年 3月25日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左

区分	第5期 [平成31年 3月25日現在]	第6期 [令和 2年 3月25日現在]
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第5期 [平成31年 3月25日現在]	第6期 [令和 2年 3月25日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	88,755,372	99,726,413
合計	88,755,372	99,726,413

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	第5期 [平成31年 3月25日現在]	第6期 [令和 2年 3月25日現在]
1口当たり純資産額	1.1294円	1.1178円
(1万口当たり純資産額)	(11,294円)	(11,178円)

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	1,557,513,835	2,155,443,396	
	日本債券インデックスマザーファンド	3,274,375,679	4,424,336,417	
合 計		4,831,889,514	6,579,779,813	

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドの主要投資対象の状況は以下の通りです。
なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 2年 3月25日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	30,190,440,441
国債証券	481,162,231,980
地方債証券	29,561,378,250
特殊債券	36,211,639,759
社債券	26,586,794,000
未収入金	54,882,689,749
未収利息	585,035,959
前払金	14,160,000
前払費用	81,779,393
差入委託証拠金	4,920,000
流動資産合計	659,281,069,531
資産合計	659,281,069,531

[令和 2年 3月25日現在]

負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,524,400
未払解約金	66,488,033,829
未払利息	15,351
流動負債合計	66,502,573,580
負債合計	66,502,573,580
純資産の部	
元本等	
元本	438,712,316,788
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	154,066,179,163
元本等合計	592,778,495,951
純資産合計	592,778,495,951
負債純資産合計	659,281,069,531

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 2年 3月25日現在]
1. 期首	平成31年 3月26日
期首元本額	442,251,214,744円
期中追加設定元本額	286,797,075,707円
期中一部解約元本額	290,335,973,663円
元本の内訳	
ファンド・マネジャー（国内債券）	144,670,729,778円
e M A X I S 国内債券インデックス	9,070,293,741円
e M A X I S バランス（8資産均等型）	2,118,421,000円
e M A X I S バランス（波乗り型）	570,521,496円
コアバランス	1,688,616円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	425,808,034円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	203,274,127円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	79,518,988円
e M A X I S S l i m 国内債券インデックス	6,074,004,669円
国内債券セレクション（ラップ向け）	3,848,186,656円

	[令和 2年 3月25日現在]
eMAXIS Slim バランス（８資産均等型）	3,297,603,681円
つみたて８資産均等バランス	1,299,857,805円
つみたて４資産均等バランス	400,890,202円
eMAXIS マイマネージャー １９７０s	2,905,181円
eMAXIS マイマネージャー １９８０s	796,447円
eMAXIS マイマネージャー １９９０s	60,663円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３５（確定拠出年金）	109,196,175円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４５（確定拠出年金）	38,242,745円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５５（確定拠出年金）	16,130,753円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金）	14,414,260円
国内債券インデックスファンド（ラップ向け）	727,857円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	10,738,572,510円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	10,874,556,648円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	2,080,719,942円
三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）	3,274,375,679円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	6,225,395,232円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	242,394,210円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	256,630,202円
eMAXIS 債券バランス（２資産均等型）	73,547,051円
eMAXIS バランス（４資産均等型）	340,042,514円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	612,457,524円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	300,635,439円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	561,969,639円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	49,400,922円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	10,766,598円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	75,545,088円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,368,271,489円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	1,120,106,600円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	4,471,419,702円
ＭＵＡＭ 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	131,606,753,173円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	462,487,803円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,159,985円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	5,887,383円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,249,676,780円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,156,167,301円

	[令和 2年 3月25日現在]
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	18,616,910,048円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	7,865,619,109円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	6,203,926,921円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	211,813,250円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	18,818,550,250円
MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	1,083,773,857円
MUKAM 日本債券インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	3,888,705,201円
MUKAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	732,072円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2（適格機関投資家限定）	5,891,900,833円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	14,593,103円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	26,411,898円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	14,869,087円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	10,742,080円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	85,512,856円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	193,835,496円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	65,811,065円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	128,888,445円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	4,114,412,360円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	1,850,601,066円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	3,319,714,190円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	1,813,085,714円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	1,070,695,599円
合計	438,712,316,788円
2. 受益権の総数	438,712,316,788口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成31年 3月26日 至 令和 2年 3月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、債券先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 2年 3月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[令和 2年 3月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	3,630,647,750

地方債証券	316,497,469
特殊債券	202,580,374
社債券	264,420,500
合計	4,414,146,093

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

債券関連

[令和 2年 3月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	622,160,000	—	607,640,000	14,520,000
	合計	622,160,000	—	607,640,000	14,520,000

（注）時価の算定方法

- 1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[令和 2年 3月25日現在]
1口当たり純資産額	1.3512円
(1万口当たり純資産額)	(13,512円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第 3 9 9 回利付国債（ 2 年 ）	300,000,000	301,068,000	
	第 4 0 0 回利付国債（ 2 年 ）	1,300,000,000	1,304,862,000	
	第 4 0 4 回利付国債（ 2 年 ）	850,000,000	853,850,500	
	第 4 0 7 回利付国債（ 2 年 ）	450,000,000	452,358,000	
	第 4 0 8 回利付国債（ 2 年 ）	9,550,000,000	9,602,525,000	
	第 4 0 9 回利付国債（ 2 年 ）	3,300,000,000	3,319,041,000	
	第 1 2 8 回利付国債（ 5 年 ）	3,850,000,000	3,865,246,000	
	第 1 2 9 回利付国債（ 5 年 ）	3,100,000,000	3,114,787,000	
	第 1 3 0 回利付国債（ 5 年 ）	4,950,000,000	4,976,730,000	
	第 1 3 1 回利付国債（ 5 年 ）	5,010,000,000	5,039,909,700	
	第 1 3 2 回利付国債（ 5 年 ）	3,850,000,000	3,875,487,000	
	第 1 3 3 回利付国債（ 5 年 ）	900,000,000	906,516,000	
	第 1 3 4 回利付国債（ 5 年 ）	7,760,000,000	7,821,847,200	
	第 1 3 5 回利付国債（ 5 年 ）	1,880,000,000	1,896,356,000	
	第 1 3 6 回利付国債（ 5 年 ）	2,750,000,000	2,774,145,000	
	第 1 3 7 回利付国債（ 5 年 ）	6,000,000,000	6,051,480,000	
	第 1 3 8 回利付国債（ 5 年 ）	5,150,000,000	5,194,444,500	
	第 1 3 9 回利付国債（ 5 年 ）	600,000,000	605,400,000	
	第 1 4 0 回利付国債（ 5 年 ）	1,960,000,000	1,978,345,600	
	第 1 4 1 回利付国債（ 5 年 ）	4,640,000,000	4,684,961,600	
	第 1 4 2 回利付国債（ 5 年 ）	4,820,000,000	4,866,995,000	
	第 1 回利付国債（ 4 0 年 ）	475,000,000	725,025,750	
	第 2 回利付国債（ 4 0 年 ）	870,000,000	1,293,524,700	
	第 3 回利付国債（ 4 0 年 ）	733,000,000	1,100,973,330	
	第 4 回利付国債（ 4 0 年 ）	1,098,000,000	1,665,786,780	
	第 5 回利付国債（ 4 0 年 ）	1,195,000,000	1,759,613,600	
	第 6 回利付国債（ 4 0 年 ）	1,000,000,000	1,454,030,000	
	第 7 回利付国債（ 4 0 年 ）	1,240,000,000	1,737,847,600	
	第 8 回利付国債（ 4 0 年 ）	1,220,000,000	1,604,251,200	
	第 9 回利付国債（ 4 0 年 ）	1,950,000,000	1,928,764,500	
	第 1 0 回利付国債（ 4 0 年 ）	1,530,000,000	1,770,745,500	
	第 1 1 回利付国債（ 4 0 年 ）	2,010,000,000	2,263,903,200	
	第 1 2 回利付国債（ 4 0 年 ）	1,540,000,000	1,573,356,400	
	第 3 1 5 回利付国債（ 1 0 年 ）	3,633,000,000	3,696,904,470	
	第 3 1 6 回利付国債（ 1 0 年 ）	2,280,000,000	2,317,278,000	
	第 3 1 7 回利付国債（ 1 0 年 ）	1,957,000,000	1,995,552,900	
	第 3 1 8 回利付国債（ 1 0 年 ）	2,480,000,000	2,525,136,000	
	第 3 1 9 回利付国債（ 1 0 年 ）	1,719,000,000	1,758,090,060	

第３２０回利付国債（１０年）	1,980,000,000	2,021,580,000	
第３２１回利付国債（１０年）	2,515,000,000	2,574,831,850	
第３２２回利付国債（１０年）	1,470,000,000	1,502,046,000	
第３２３回利付国債（１０年）	1,675,000,000	1,715,987,250	
第３２４回利付国債（１０年）	2,800,000,000	2,862,216,000	
第３２５回利付国債（１０年）	3,835,000,000	3,929,379,350	
第３２６回利付国債（１０年）	730,000,000	747,666,000	
第３２７回利付国債（１０年）	2,540,000,000	2,608,453,000	
第３２８回利付国債（１０年）	3,700,000,000	3,786,543,000	
第３２９回利付国債（１０年）	5,860,000,000	6,043,945,400	
第３３０回利付国債（１０年）	3,330,000,000	3,440,289,600	
第３３１回利付国債（１０年）	1,060,000,000	1,087,676,600	
第３３２回利付国債（１０年）	5,040,000,000	5,178,146,400	
第３３３回利付国債（１０年）	6,550,000,000	6,740,081,000	
第３３４回利付国債（１０年）	4,330,000,000	4,463,667,100	
第３３５回利付国債（１０年）	4,470,000,000	4,596,054,000	
第３３６回利付国債（１０年）	3,880,000,000	3,994,576,400	
第３３７回利付国債（１０年）	940,000,000	958,574,400	
第３３８回利付国債（１０年）	3,580,000,000	3,671,469,000	
第３３９回利付国債（１０年）	6,660,000,000	6,837,022,800	
第３４０回利付国債（１０年）	2,250,000,000	2,312,707,500	
第３４１回利付国債（１０年）	3,570,000,000	3,653,430,900	
第３４２回利付国債（１０年）	8,240,000,000	8,339,127,200	
第３４３回利付国債（１０年）	3,010,000,000	3,047,745,400	
第３４４回利付国債（１０年）	5,110,000,000	5,176,736,600	
第３４５回利付国債（１０年）	4,440,000,000	4,500,206,400	
第３４６回利付国債（１０年）	3,290,000,000	3,335,073,000	
第３４７回利付国債（１０年）	4,920,000,000	4,988,043,600	
第３４８回利付国債（１０年）	5,700,000,000	5,777,235,000	
第３４９回利付国債（１０年）	3,790,000,000	3,840,103,800	
第３５０回利付国債（１０年）	5,070,000,000	5,135,048,100	
第３５１回利付国債（１０年）	5,410,000,000	5,477,084,000	
第３５２回利付国債（１０年）	4,090,000,000	4,136,994,100	
第３５３回利付国債（１０年）	3,500,000,000	3,536,750,000	
第３５４回利付国債（１０年）	5,690,000,000	5,743,656,700	
第３５５回利付国債（１０年）	5,350,000,000	5,396,866,000	
第３５６回利付国債（１０年）	4,000,000,000	4,030,280,000	
第３５７回利付国債（１０年）	3,280,000,000	3,302,271,200	
第１回利付国債（３０年）	76,000,000	95,916,560	
第２回利付国債（３０年）	98,000,000	120,821,260	
第３回利付国債（３０年）	117,000,000	143,513,370	
第４回利付国債（３０年）	127,000,000	164,835,840	

第 5 回利付国債（ 3 0 年）	108,000,000	132,937,200	
第 6 回利付国債（ 3 0 年）	169,000,000	213,043,090	
第 7 回利付国債（ 3 0 年）	164,000,000	206,198,840	
第 8 回利付国債（ 3 0 年）	142,000,000	170,685,420	
第 9 回利付国債（ 3 0 年）	116,000,000	133,703,920	
第 1 0 回利付国債（ 3 0 年）	185,000,000	206,330,500	
第 1 1 回利付国債（ 3 0 年）	137,000,000	163,708,150	
第 1 2 回利付国債（ 3 0 年）	220,000,000	275,077,000	
第 1 3 回利付国債（ 3 0 年）	205,000,000	254,163,100	
第 1 4 回利付国債（ 3 0 年）	493,000,000	639,667,500	
第 1 5 回利付国債（ 3 0 年）	346,000,000	455,204,520	
第 1 6 回利付国債（ 3 0 年）	302,000,000	398,673,220	
第 1 7 回利付国債（ 3 0 年）	327,000,000	428,448,480	
第 1 8 回利付国債（ 3 0 年）	427,000,000	555,023,140	
第 1 9 回利付国債（ 3 0 年）	303,000,000	395,033,220	
第 2 0 回利付国債（ 3 0 年）	495,000,000	662,047,650	
第 2 1 回利付国債（ 3 0 年）	379,000,000	497,013,020	
第 2 2 回利付国債（ 3 0 年）	570,000,000	767,698,800	
第 2 3 回利付国債（ 3 0 年）	554,000,000	749,063,400	
第 2 4 回利付国債（ 3 0 年）	411,000,000	557,874,960	
第 2 5 回利付国債（ 3 0 年）	742,000,000	986,355,440	
第 2 6 回利付国債（ 3 0 年）	884,000,000	1,193,638,680	
第 2 7 回利付国債（ 3 0 年）	860,000,000	1,183,213,800	
第 2 8 回利付国債（ 3 0 年）	911,000,000	1,261,580,130	
第 2 9 回利付国債（ 3 0 年）	1,450,000,000	1,995,591,500	
第 3 0 回利付国債（ 3 0 年）	1,496,000,000	2,046,243,760	
第 3 1 回利付国債（ 3 0 年）	1,358,000,000	1,846,635,560	
第 3 2 回利付国債（ 3 0 年）	1,739,000,000	2,412,897,280	
第 3 3 回利付国債（ 3 0 年）	1,644,000,000	2,196,137,400	
第 3 4 回利付国債（ 3 0 年）	2,116,000,000	2,924,079,240	
第 3 5 回利付国債（ 3 0 年）	1,949,000,000	2,625,770,760	
第 3 6 回利付国債（ 3 0 年）	1,829,000,000	2,475,332,020	
第 3 7 回利付国債（ 3 0 年）	2,757,000,000	3,690,161,790	
第 3 8 回利付国債（ 3 0 年）	745,000,000	985,269,950	
第 3 9 回利付国債（ 3 0 年）	1,040,000,000	1,401,441,600	
第 4 0 回利付国債（ 3 0 年）	1,560,000,000	2,071,149,600	
第 4 1 回利付国債（ 3 0 年）	1,450,000,000	1,895,614,000	
第 4 2 回利付国債（ 3 0 年）	660,000,000	863,834,400	
第 4 3 回利付国債（ 3 0 年）	2,100,000,000	2,754,885,000	
第 4 4 回利付国債（ 3 0 年）	110,000,000	144,470,700	
第 4 5 回利付国債（ 3 0 年）	1,850,000,000	2,347,705,500	
第 4 6 回利付国債（ 3 0 年）	1,440,000,000	1,828,857,600	

第４７回利付国債（３０年）	1,880,000,000	2,436,198,000	
第４８回利付国債（３０年）	1,190,000,000	1,485,857,800	
第４９回利付国債（３０年）	1,760,000,000	2,198,908,800	
第５０回利付国債（３０年）	1,260,000,000	1,388,419,200	
第５１回利付国債（３０年）	1,770,000,000	1,730,015,700	
第５２回利付国債（３０年）	1,660,000,000	1,703,824,000	
第５３回利付国債（３０年）	1,880,000,000	1,975,579,200	
第５４回利付国債（３０年）	1,000,000,000	1,101,440,000	
第５５回利付国債（３０年）	1,260,000,000	1,388,898,000	
第５６回利付国債（３０年）	2,170,000,000	2,390,862,600	
第５７回利付国債（３０年）	1,110,000,000	1,223,908,200	
第５８回利付国債（３０年）	2,420,000,000	2,670,324,800	
第５９回利付国債（３０年）	380,000,000	409,438,600	
第６０回利付国債（３０年）	2,440,000,000	2,759,030,000	
第６１回利付国債（３０年）	1,490,000,000	1,605,206,800	
第６３回利付国債（３０年）	30,000,000	29,882,400	
第６４回利付国債（３０年）	3,410,000,000	3,396,530,500	
第６５回利付国債（３０年）	950,000,000	946,219,000	
第５１回利付国債（２０年）	200,000,000	205,526,000	
第５２回利付国債（２０年）	214,000,000	221,438,640	
第５４回利付国債（２０年）	480,000,000	500,121,600	
第５５回利付国債（２０年）	241,000,000	251,522,060	
第５６回利付国債（２０年）	449,000,000	471,023,450	
第５８回利付国債（２０年）	147,000,000	154,639,590	
第５９回利付国債（２０年）	589,000,000	619,457,190	
第６１回利付国債（２０年）	289,000,000	299,227,710	
第６３回利付国債（２０年）	442,000,000	470,252,640	
第６４回利付国債（２０年）	441,000,000	472,527,090	
第６５回利付国債（２０年）	318,000,000	342,174,360	
第６６回利付国債（２０年）	500,000,000	536,135,000	
第６８回利付国債（２０年）	846,000,000	924,559,560	
第７０回利付国債（２０年）	422,000,000	467,272,160	
第７１回利付国債（２０年）	160,000,000	175,801,600	
第７２回利付国債（２０年）	534,000,000	587,485,440	
第７３回利付国債（２０年）	620,000,000	682,130,200	
第７４回利付国債（２０年）	318,000,000	351,380,460	
第７５回利付国債（２０年）	575,000,000	638,514,500	
第７６回利付国債（２０年）	200,000,000	220,088,000	
第７７回利付国債（２０年）	210,000,000	232,144,500	
第７８回利付国債（２０年）	410,000,000	453,156,600	
第７９回利付国債（２０年）	50,000,000	55,526,000	
第８０回利付国債（２０年）	315,000,000	351,470,700	

第 8 1 回利付国債（ 2 0 年）	350,000,000	390,554,500	
第 8 2 回利付国債（ 2 0 年）	662,000,000	742,360,180	
第 8 3 回利付国債（ 2 0 年）	413,000,000	465,426,220	
第 8 4 回利付国債（ 2 0 年）	670,000,000	751,183,900	
第 8 5 回利付国債（ 2 0 年）	490,000,000	554,724,100	
第 8 6 回利付国債（ 2 0 年）	515,000,000	589,221,800	
第 8 7 回利付国債（ 2 0 年）	450,000,000	512,145,000	
第 8 8 回利付国債（ 2 0 年）	804,000,000	924,784,920	
第 8 9 回利付国債（ 2 0 年）	410,000,000	469,023,600	
第 9 0 回利付国債（ 2 0 年）	1,100,000,000	1,264,791,000	
第 9 1 回利付国債（ 2 0 年）	468,000,000	541,167,120	
第 9 2 回利付国債（ 2 0 年）	1,432,000,000	1,645,110,240	
第 9 3 回利付国債（ 2 0 年）	390,000,000	447,279,300	
第 9 4 回利付国債（ 2 0 年）	615,000,000	709,648,500	
第 9 5 回利付国債（ 2 0 年）	1,017,000,000	1,193,581,710	
第 9 6 回利付国債（ 2 0 年）	320,000,000	370,902,400	
第 9 7 回利付国債（ 2 0 年）	343,000,000	401,755,900	
第 9 8 回利付国債（ 2 0 年）	470,000,000	546,971,900	
第 9 9 回利付国債（ 2 0 年）	1,345,000,000	1,571,430,750	
第 1 0 0 回利付国債（ 2 0 年）	1,060,000,000	1,251,669,200	
第 1 0 1 回利付国債（ 2 0 年）	573,000,000	685,800,780	
第 1 0 2 回利付国債（ 2 0 年）	530,000,000	637,113,000	
第 1 0 3 回利付国債（ 2 0 年）	640,000,000	764,057,600	
第 1 0 4 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	353,193,000	
第 1 0 5 回利付国債（ 2 0 年）	870,000,000	1,028,122,500	
第 1 0 6 回利付国債（ 2 0 年）	711,000,000	846,274,860	
第 1 0 7 回利付国債（ 2 0 年）	567,000,000	672,201,180	
第 1 0 8 回利付国債（ 2 0 年）	800,000,000	934,432,000	
第 1 0 9 回利付国債（ 2 0 年）	800,000,000	936,968,000	
第 1 1 0 回利付国債（ 2 0 年）	1,096,000,000	1,303,341,280	
第 1 1 1 回利付国債（ 2 0 年）	711,000,000	855,062,820	
第 1 1 2 回利付国債（ 2 0 年）	1,340,000,000	1,599,142,600	
第 1 1 3 回利付国債（ 2 0 年）	1,182,000,000	1,414,806,720	
第 1 1 4 回利付国債（ 2 0 年）	1,520,000,000	1,825,459,200	
第 1 1 5 回利付国債（ 2 0 年）	1,154,000,000	1,397,113,180	
第 1 1 6 回利付国債（ 2 0 年）	246,000,000	298,688,280	
第 1 1 7 回利付国債（ 2 0 年）	1,090,000,000	1,312,621,600	
第 1 1 8 回利付国債（ 2 0 年）	1,076,000,000	1,288,348,600	
第 1 1 9 回利付国債（ 2 0 年）	660,000,000	776,826,600	
第 1 2 0 回利付国債（ 2 0 年）	760,000,000	879,061,600	
第 1 2 1 回利付国債（ 2 0 年）	1,139,000,000	1,355,296,100	
第 1 2 2 回利付国債（ 2 0 年）	1,160,000,000	1,368,220,000	

第 1 2 3 回利付国債（ 2 0 年 ）	618,000,000	750,493,020	
第 1 2 4 回利付国債（ 2 0 年 ）	750,000,000	902,812,500	
第 1 2 5 回利付国債（ 2 0 年 ）	3,104,000,000	3,812,146,560	
第 1 2 7 回利付国債（ 2 0 年 ）	350,000,000	418,442,500	
第 1 2 8 回利付国債（ 2 0 年 ）	494,000,000	592,138,040	
第 1 3 0 回利付国債（ 2 0 年 ）	2,052,000,000	2,441,243,880	
第 1 3 1 回利付国債（ 2 0 年 ）	280,000,000	329,940,800	
第 1 3 2 回利付国債（ 2 0 年 ）	187,000,000	220,811,470	
第 1 3 3 回利付国債（ 2 0 年 ）	3,640,000,000	4,340,226,800	
第 1 3 4 回利付国債（ 2 0 年 ）	3,205,000,000	3,829,782,700	
第 1 3 7 回利付国債（ 2 0 年 ）	232,000,000	275,040,640	
第 1 3 8 回利付国債（ 2 0 年 ）	400,000,000	464,600,000	
第 1 3 9 回利付国債（ 2 0 年 ）	400,000,000	469,404,000	
第 1 4 0 回利付国債（ 2 0 年 ）	2,397,000,000	2,847,180,570	
第 1 4 1 回利付国債（ 2 0 年 ）	420,000,000	499,800,000	
第 1 4 2 回利付国債（ 2 0 年 ）	4,110,000,000	4,942,110,600	
第 1 4 3 回利付国債（ 2 0 年 ）	2,010,000,000	2,370,594,000	
第 1 4 4 回利付国債（ 2 0 年 ）	350,000,000	408,352,000	
第 1 4 5 回利付国債（ 2 0 年 ）	2,410,000,000	2,879,829,500	
第 1 4 6 回利付国債（ 2 0 年 ）	2,740,000,000	3,279,780,000	
第 1 4 7 回利付国債（ 2 0 年 ）	3,340,000,000	3,959,870,600	
第 1 4 8 回利付国債（ 2 0 年 ）	2,030,000,000	2,382,489,200	
第 1 4 9 回利付国債（ 2 0 年 ）	2,860,000,000	3,362,988,200	
第 1 5 0 回利付国債（ 2 0 年 ）	2,910,000,000	3,387,327,300	
第 1 5 1 回利付国債（ 2 0 年 ）	2,940,000,000	3,341,721,600	
第 1 5 2 回利付国債（ 2 0 年 ）	2,420,000,000	2,754,008,400	
第 1 5 3 回利付国債（ 2 0 年 ）	1,860,000,000	2,146,626,000	
第 1 5 4 回利付国債（ 2 0 年 ）	2,310,000,000	2,635,224,900	
第 1 5 5 回利付国債（ 2 0 年 ）	2,910,000,000	3,235,541,700	
第 1 5 6 回利付国債（ 2 0 年 ）	2,530,000,000	2,578,398,900	
第 1 5 7 回利付国債（ 2 0 年 ）	2,090,000,000	2,064,021,300	
第 1 5 8 回利付国債（ 2 0 年 ）	2,630,000,000	2,721,182,100	
第 1 5 9 回利付国債（ 2 0 年 ）	1,470,000,000	1,545,205,200	
第 1 6 0 回利付国債（ 2 0 年 ）	2,270,000,000	2,424,564,300	
第 1 6 1 回利付国債（ 2 0 年 ）	3,680,000,000	3,870,440,000	
第 1 6 2 回利付国債（ 2 0 年 ）	1,050,000,000	1,105,093,500	
第 1 6 3 回利付国債（ 2 0 年 ）	1,860,000,000	1,957,259,400	
第 1 6 4 回利付国債（ 2 0 年 ）	3,100,000,000	3,208,500,000	
第 1 6 5 回利付国債（ 2 0 年 ）	1,680,000,000	1,738,077,600	
第 1 6 6 回利付国債（ 2 0 年 ）	2,080,000,000	2,225,724,800	
第 1 6 7 回利付国債（ 2 0 年 ）	2,100,000,000	2,172,576,000	
第 1 6 8 回利付国債（ 2 0 年 ）	2,070,000,000	2,105,272,800	

	第１６９回利付国債（２０年）	800,000,000	800,000,000	
	第１７０回利付国債（２０年）	3,080,000,000	3,080,000,000	
	第１７１回利付国債（２０年）	1,220,000,000	1,221,134,600	
国債証券 合計		441,434,000,000	481,162,231,980	
地方債証券	第１回東京都公募公債（２０年）	20,000,000	20,956,800	
	第７回東京都公募公債（２０年）	560,000,000	622,630,400	
	第７回東京都公募公債（３０年）	10,000,000	13,794,800	
	第８回東京都公募公債（３０年）	80,000,000	106,367,200	
	第２０回東京都公募公債（２０年）	80,000,000	94,430,400	
	第２１回東京都公募公債（２０年）	80,000,000	95,479,200	
	第２２回東京都公募公債（２０年）	120,000,000	140,848,800	
	第２８回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	116,121,000	
	第３３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	97,018,000	
	第７００回東京都公募公債	200,000,000	202,842,000	
	第７０５回東京都公募公債	170,000,000	173,362,600	
	第７０９回東京都公募公債	100,000,000	101,609,000	
	第７２２回東京都公募公債	100,000,000	102,392,000	
	第７２９回東京都公募公債	100,000,000	102,504,000	
	第７５０回東京都公募公債	200,000,000	203,808,000	
	第７５８回東京都公募公債	300,000,000	298,233,000	
	第７６５回東京都公募公債	300,000,000	301,974,000	
	第７６８回東京都公募公債	100,000,000	100,429,000	
	平成２５年度第４回北海道公募公債	100,000,000	102,570,000	
	平成２５年度第７回北海道公募公債	150,000,000	153,801,000	
	平成２５年度第９回北海道公募公債	300,000,000	306,900,000	
	平成２８年度第１２回北海道公募公債	600,000,000	601,200,000	
	平成２９年度第１５回北海道公募公債	117,000,000	117,861,120	
	第２９回１号宮城県公募公債	100,000,000	102,217,000	
	第１回神奈川県公募公債（３０年）	200,000,000	264,320,000	
	第２回神奈川県公募公債（２０年）	80,000,000	87,776,000	
	第２回神奈川県公募公債（３０年）	80,000,000	111,480,000	
	第２７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	114,690,000	
	第１９１回神奈川県公募公債	100,000,000	101,721,000	
	第２３２回神奈川県公募公債	200,000,000	201,104,000	
	第１１回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	235,538,000	
	第３４８回大阪府公募公債	10,000,000	10,128,100	
	第３５１回大阪府公募公債	100,000,000	101,515,000	
	第３５８回大阪府公募公債	56,000,000	56,982,800	
	第３５９回大阪府公募公債	56,000,000	57,046,080	
	第３７６回大阪府公募公債	106,000,000	108,819,600	
	第３８５回大阪府公募公債	200,000,000	205,010,000	
	第３８８回大阪府公募公債	400,000,000	408,632,000	

第３９３回大阪府公募公債	110,000,000	112,203,300	
第３９４回大阪府公募公債	200,000,000	203,674,000	
第４１９回大阪府公募公債	700,000,000	702,996,000	
第４２９回大阪府公募公債	103,000,000	103,570,620	
第４５１回大阪府公募公債	500,000,000	493,665,000	
平成２３年度第９回京都府公募公債	140,000,000	142,623,600	
平成２４年度第１０回京都府公募公債	100,000,000	101,821,000	
平成２７年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	112,856,000	
第２回兵庫県公募公債（２０年）	300,000,000	349,674,000	
第２回兵庫県公募公債（３０年）	40,000,000	55,118,000	
第３回兵庫県公募公債（２０年）	400,000,000	464,548,000	
第４回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	109,056,000	
第５回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	109,493,000	
第９回兵庫県公募公債（１５年）	200,000,000	215,662,000	
平成２８年度第２回兵庫県公募公債	400,000,000	398,668,000	
平成２８年度第３回兵庫県公募公債	700,000,000	697,641,000	
第２９回兵庫県公募公債（２０年）	200,000,000	202,130,000	
第３回静岡県公募公債（１５年）	100,000,000	109,373,000	
平成２３年度第１回静岡県公募公債	100,000,000	101,426,000	
平成２５年度第１回静岡県公募公債	100,000,000	101,595,000	
平成２５年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	102,881,000	
平成２５年度第８回静岡県公募公債	130,000,000	132,969,200	
平成２３年度第７回愛知県公募公債	100,000,000	101,411,000	
平成２３年度第９回愛知県公募公債	100,000,000	101,453,000	
平成２３年度第１３回愛知県公募公債	300,000,000	327,906,000	
平成２３年度第１４回愛知県公募公債	100,000,000	101,592,000	
平成２３年度第１７回愛知県公募公債	100,000,000	101,734,000	
平成２４年度第１３回愛知県公募公債	100,000,000	101,908,000	
平成３０年度第１７回愛知県公募公債	400,000,000	399,740,000	
平成２２年度第８回広島県公募公債	26,650,000	26,989,521	
平成２３年度第１回広島県公募公債	100,000,000	101,325,000	
平成２８年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	100,608,000	
平成２９年度第７回広島県公募公債	100,000,000	100,673,000	
第４回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	230,516,000	
第１６回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	112,645,000	
平成２３年度第１回埼玉県公募公債	100,000,000	101,431,000	
平成２３年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	101,525,000	
平成２４年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	101,915,000	
平成２６年度第８回埼玉県公募公債	100,000,000	101,327,000	
平成２９年度第８回埼玉県公募公債	200,000,000	201,974,000	
平成１９年度第１回福岡県公募公債（３０年）	70,000,000	96,559,400	
平成２０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	80,000,000	107,063,200	

平成２６年度第８回福岡県公募公債	100,000,000	101,803,000	
平成２６年度第１回福岡県公募公債	100,000,000	102,521,000	
平成２７年度第７回福岡県公募公債	100,000,000	102,022,000	
第９回千葉県公募公債（２０年）	80,000,000	93,504,000	
平成２３年度第９回千葉県公募公債	20,000,000	20,375,400	
平成２４年度第１回千葉県公募公債	20,000,000	20,412,200	
平成２４年度第６回千葉県公募公債	100,000,000	102,000,000	
平成２５年度第１回千葉県公募公債	82,500,000	83,820,825	
平成２５年度第８回千葉県公募公債	100,000,000	102,232,000	
第７回群馬県公募公債（２０年）	300,000,000	297,372,000	
平成２４年度第１回大分県公募公債	100,260,000	102,187,999	
平成２７年度第１回大分県公募公債	203,400,000	207,543,258	
第９９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,776,000	
第１００回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,526,000	
第１０１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,403,000	
第１０６回共同発行市場公募地方債	1,000,000,000	1,016,710,000	
第１０９回共同発行市場公募地方債	170,000,000	173,503,700	
第１１０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,796,000	
第１１３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,715,000	
第１１４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,894,000	
第１２０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,855,000	
第１２６回共同発行市場公募地方債	210,000,000	215,504,100	
第１２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,217,000	
第１２９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,868,000	
第１３０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,681,000	
第１３２回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,788,000	
第１３５回共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,620,000	
第１４０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,142,000	
第１４２回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,744,000	
第１４４回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,580,000	
第１４５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,496,000	
第１４６回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,548,000	
第１５３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,051,000	
第１６２回共同発行市場公募地方債	300,000,000	299,712,000	
第１６３回共同発行市場公募地方債	300,000,000	298,857,000	
第１７０回共同発行市場公募地方債	400,000,000	401,560,000	
第１７８回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,738,000	
平成２４年度第２回堺市公募公債	200,000,000	203,578,000	
平成２５年度第１回長崎県公募公債	200,000,000	205,250,000	
平成２８年度第２回島根県公募公債（２０年）	100,000,000	102,039,000	
平成２３年度第１回滋賀県公募公債	100,000,000	101,615,000	
平成２５年度第１回栃木県公募公債	100,000,000	102,167,000	

平成 2 4 年度第 2 回熊本県公募公債	50,000,000	50,956,500	
平成 2 3 年度第 1 回浜松市公募公債	238,200,000	242,116,008	
平成 2 4 年度第 1 回浜松市公募公債	100,000,000	102,221,000	
平成 2 5 年度第 1 回浜松市公募公債	161,000,000	165,319,630	
第 1 回大阪市公募公債（ 1 5 年）	200,000,000	220,418,000	
第 5 回大阪市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	119,753,000	
平成 2 3 年度第 1 0 回大阪市公募公債	10,000,000	10,165,000	
第 1 回名古屋市公募公債（ 2 0 年）	200,000,000	214,404,000	
第 1 回名古屋市公募公債（ 3 0 年）	200,000,000	263,208,000	
第 9 回名古屋市公募公債（ 2 0 年）	400,000,000	467,044,000	
第 1 0 回名古屋市公募公債（ 2 0 年）	80,000,000	95,594,400	
第 4 7 7 回名古屋市公募公債	100,000,000	101,692,000	
第 1 回京都市公募公債（ 2 0 年）	200,000,000	219,660,000	
第 5 回京都市公募公債（ 2 0 年）	50,000,000	57,501,500	
平成 2 3 年度第 2 回京都市公募公債	100,000,000	101,404,000	
平成 2 3 年度第 4 回京都市公募公債	350,000,000	356,142,500	
平成 2 4 年度第 4 回京都市公募公債	100,000,000	101,905,000	
平成 2 0 年度第 2 4 回神戸市公募公債（ 2 0 年）	300,000,000	350,541,000	
平成 2 2 年度第 4 回神戸市公募公債	100,000,000	117,384,000	
第 7 回横浜市公募公債（ 2 0 年）	200,000,000	222,238,000	
第 2 0 回横浜市公募公債（ 2 0 年）	80,000,000	94,580,800	
平成 2 4 年度第 4 回横浜市公募公債	100,000,000	102,178,000	
平成 2 7 年度第 2 回横浜市公募公債	200,000,000	204,760,000	
第 2 7 回横浜市公募公債（ 2 0 年）	60,000,000	69,814,800	
第 3 3 回横浜市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	99,243,000	
第 3 5 回横浜市公募公債（ 2 0 年）	300,000,000	303,192,000	
平成 2 2 年度第 8 回札幌市公募公債（ 3 0 年）	80,000,000	109,785,600	
平成 2 3 年度第 3 回札幌市公募公債	300,000,000	356,463,000	
平成 2 6 年度第 5 回札幌市公募公債	100,000,000	107,436,000	
平成 2 7 年度第 9 回札幌市公募公債	100,000,000	100,455,000	
第 1 7 回北九州市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	116,072,000	
平成 2 5 年度第 3 回北九州市公募公債	300,000,000	307,509,000	
平成 2 3 年度第 6 回福岡市公募公債	100,000,000	101,497,000	
平成 2 4 年度第 4 回福岡市公募公債	200,000,000	203,846,000	
平成 2 5 年度第 4 回福岡市公募公債	50,000,000	51,108,000	
平成 2 6 年度第 6 回福岡市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	114,238,000	
平成 2 5 年度第 2 回広島市公募公債	100,000,000	102,475,000	
平成 2 9 年度第 6 回広島市公募公債	300,000,000	302,676,000	
平成 2 4 年度第 1 回相模原市公募公債	200,000,000	203,556,000	
平成 2 3 年度第 1 回三重県公募公債	98,410,000	100,001,289	
平成 2 4 年度第 4 回福井県公募公債	100,000,000	101,232,000	
平成 2 6 年度第 4 回福井県公募公債	100,000,000	101,592,000	

	平成２３年度第１回徳島県公募公債	100,000,000	101,615,000	
	平成２４年度第１回山梨県公募公債	200,000,000	203,834,000	
	平成３０年度第１回山梨県公募公債	100,000,000	101,352,000	
	平成２４年度第２回岡山県公募公債	100,000,000	101,863,000	
	平成２６年度第１回岡山市公募公債	100,000,000	101,305,000	
	第４回京都市保証京都市土地開発公社債券	200,000,000	199,430,000	
	第９６回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	100,000,000	116,972,000	
	第１３２回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	101,851,000	
地方債証券 合計		28,168,420,000	29,561,378,250	
特殊債券	第３回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	102,675,000	
	第１１回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債	400,000,000	399,876,000	
	第１９回政府保証日本政策投資銀行	400,000,000	407,760,000	
	第２２回政府保証日本政策投資銀行	20,000,000	20,506,000	
	第６０回政府保証日本政策投資銀行債券	1,500,000,000	1,499,070,000	
	第９４回日本政策投資銀行債券（財投機関債）	200,000,000	199,926,000	
	第９回道路債券（財投機関債）	100,000,000	130,874,000	
	第１８回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	30,000,000	47,200,200	
	第１９回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	154,556,000	
	第２２回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	130,000,000	198,672,500	
	第２３回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	500,000,000	582,590,000	
	第３３回道路債券（財投機関債）	500,000,000	672,735,000	
	第５８回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	50,000,000	59,686,500	
	第７０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	474,304,000	
	第８３回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	50,000,000	59,391,500	
	第８９回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	116,717,000	
	第１０１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	137,366,000	
	第１３５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	91,000,000	92,229,410	
	第１４２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	122,000,000	123,821,460	
	第１４５回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	245,292,000	
	第１４７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,322,000	
	第１４８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	235,880,000	
	第１４９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	136,000,000	138,384,080	

第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券 （財投機関債）	200,000,000	221,040,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券 （財投機関債）	100,000,000	140,461,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,232,000	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	212,000,000	215,849,920	
第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	109,000,000	111,030,670	
第160回日本高速道路保有・債務返済機構債券 （財投機関債）	100,000,000	113,142,000	
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	433,000,000	441,716,290	
第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,669,000	
第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	258,276,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	512,000,000	522,204,160	
第167回日本高速道路保有・債務返済機構債券 （財投機関債）	200,000,000	221,190,000	
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	430,000,000	438,681,700	
第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	408,480,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	201,000,000	205,697,370	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	170,700,000	174,018,408	
第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,143,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	153,000,000	155,487,780	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,830,000	
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	223,000,000	229,690,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,760,000	
第211回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,070,000	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	332,000,000	340,383,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	124,000,000	127,159,520	
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,826,000	
第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	283,000,000	289,350,520	
第256回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	213,000,000	217,815,930	

第288回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,970,000	
第303回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	106,000,000	107,203,100	
第318回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,101,000	
第1回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	50,000,000	59,634,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券（8年）	300,000,000	302,847,000	
第3回公営企業債券（20年）（財投機関債）	20,000,000	20,601,000	
第5回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	315,120,000	
第6回公営企業債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	107,492,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	200,000,000	237,058,000	
第9回公営企業債券（20年）（財投機関債）	50,000,000	55,170,500	
第11回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	300,000,000	350,838,000	
第14回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	80,000,000	96,834,400	
第16回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	80,000,000	94,080,000	
F17回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	400,000,000	411,812,000	
第17回公営企業債券（20年）（財投機関債）	150,000,000	170,740,500	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券（6年）	240,000,000	239,925,600	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	30,000,000	30,389,400	
第23回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	300,000,000	349,275,000	
F24回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	70,000,000	73,449,600	
第27回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	50,000,000	59,075,000	
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	21,000,000	21,342,300	
第30回政府保証地方公共団体金融機構債券	401,000,000	407,857,100	
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	50,000,000	50,982,500	
第33回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	400,000,000	407,800,000	
第35回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,994,000	
第39回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,879,000	
第44回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	113,159,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,320,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	17,000,000	17,330,480	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	36,000,000	36,667,080	
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	160,000,000	164,048,000	
第59回政府保証地方公共団体金融機構債券	315,000,000	323,338,050	
第61回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,654,000	
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,524,000	
第64回政府保証地方公共団体金融機構債券	240,000,000	245,673,600	

第73回政府保証地方公共団体金融機構債券	302,000,000	309,386,920	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	153,100,500	
F89回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	300,000,000	332,640,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,070,000	
F104回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	106,348,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,484,000	
第106回政府保証地方公共団体金融機構債券	116,000,000	117,243,520	
F123回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	113,871,000	
第128回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	400,000,000	398,368,000	
F149回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	106,144,000	
F197回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	300,000,000	320,862,000	
F234回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	117,567,000	
第2回政府保証公営企業債券（15年）	100,000,000	102,274,000	
第10回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	95,496,000	
第15回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	94,057,600	
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,335,000	
第48回福祉医療機構債券（財投機関債）	700,000,000	702,800,000	
第18回政府保証中部国際空港債券	558,000,000	568,897,740	
第211回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	100,219,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,217,000	13,662,148	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,713,000	14,254,937	
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,649,000	15,349,808	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,002,000	14,664,994	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	74,866,000	74,884,716	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	157,872,000	157,808,851	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,865,000	14,462,304	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	190,716,000	190,351,732	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,074,000	12,325,139	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,547,000	12,967,700	
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,851,000	14,404,901	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,560,000	15,164,240	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,569,000	12,985,410	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,940,000	15,574,501	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	13,182,000	13,694,252	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,475,000	16,360,789	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	13,560,000	14,090,602	
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,611,000	16,362,513	
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,432,000	10,510,135	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,741,000	12,919,374	

第 1 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,271,000	15,594,134	
第 1 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,375,000	15,707,868	
第 1 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	46,473,000	47,439,173	
第 1 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,771,000	12,029,138	
第 2 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,924,000	12,236,170	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,740,000	50,582,495	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,985,000	12,245,793	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,360,000	27,100,188	
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,314,000	14,787,507	
第 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,359,000	30,379,578	
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,003,000	31,974,497	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,850,000	31,673,835	
第 3 7 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,219,000	14,775,247	
第 3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,718,000	34,578,672	
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,564,000	14,063,155	
第 4 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,941,000	35,563,719	
第 4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,758,000	15,471,992	
第 4 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,380,000	14,017,690	
第 4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,334,000	41,768,774	
第 4 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,367,000	40,997,441	
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,346,000	34,452,694	
第 4 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,420,000	31,364,662	
第 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,419,000	97,359,406	
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,193,000	32,063,758	
第 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,892,000	32,723,895	
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,316,000	13,881,796	
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,524,000	35,524,377	
第 5 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,166,000	38,224,568	
第 5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,776,000	39,922,432	
第 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,766,000	44,137,473	
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	125,709,000	132,982,522	
第 5 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,894,000	45,371,986	
第 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,800,000	47,224,128	
第 6 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,999,000	48,239,611	
第 6 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,156,000	48,194,248	
第 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,157,000	50,325,991	
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,784,000	45,969,259	
第 7 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,855,000	51,539,582	
第 7 5 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	80,000,000	95,910,400	
第 7 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	296,359,000	310,433,088	
第 7 7 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	30,000,000	33,050,100	

第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,192,000	46,052,041	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,180,000	186,696,601	
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,304,000	101,475,422	
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,144,000	50,212,747	
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,143,000	53,283,334	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	101,068,000	105,151,147	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	104,042,000	108,316,045	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,764,000	57,871,879	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,342,000	59,272,705	
第91回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	116,178,000	119,920,093	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,456,000	61,055,366	
第92回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	180,000,000	183,240,000	
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	124,862,000	127,259,350	
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,141,000	74,406,227	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,192,000	74,821,954	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	144,512,000	149,620,499	
第102回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	300,000,000	327,447,000	
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	376,635,000	389,847,355	
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	413,780,000	415,819,935	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	190,000,000	209,066,500	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	256,911,000	259,025,377	
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	434,580,000	439,942,717	
第121回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	130,000,000	177,355,100	
第123回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	117,992,000	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	538,356,000	543,141,984	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,427,000	91,221,853	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,291,000	92,339,020	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,427,000	92,217,843	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,942,000	185,238,791	
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,690,000	184,988,688	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	462,475,000	466,406,037	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,808,000	187,956,869	
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,868,000	189,692,198	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,390,000	95,512,297	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,024,000	96,361,937	
第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,744,000	96,886,785	
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,330,000	195,504,697	
第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,310,000	197,233,176	
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,948,000	199,005,694	

	第１７４回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	180,000,000	199,481,400	
	第６回沖縄振興開発金融公庫債券（財投機関債）	50,000,000	55,171,000	
	い第８３２号商工債券	300,000,000	298,521,000	
	第３２２回信金中金債	300,000,000	299,589,000	
	第３２７回信金中金債	200,000,000	199,768,000	
	第３３６回信金中金債	300,000,000	299,760,000	
	第３３８回信金中金債	200,000,000	199,886,000	
	第１１号商工債券（１０年）	100,000,000	102,183,000	
	第２２３号商工債券（３年）	300,000,000	299,910,000	
	第２３０号商工債券（３年）	300,000,000	299,760,000	
	第２３６号商工債券（３年）	500,000,000	498,495,000	
	第２回信金中金債（１０年）	300,000,000	305,895,000	
	第１８回韓国輸出入銀行	100,000,000	100,037,000	
	第７回国際協力機構債券（財投機関債）	70,000,000	83,347,600	
	第３９回東日本高速道路	1,000,000,000	1,000,080,000	
	第３３回中日本高速道路	50,000,000	50,784,000	
	第６５回中日本高速道路	700,000,000	700,042,000	
特殊債券 合計		34,406,835,000	36,211,639,759	
社債券	第１４回フランス相互信用連合銀行	300,000,000	300,330,000	
	第１９回フランス相互信用連合銀行	200,000,000	204,216,000	
	第２９回フランス相互信用連合銀行	200,000,000	197,204,000	
	第８回新韓銀行	300,000,000	300,213,000	
	第１７回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー	300,000,000	299,634,000	
	第１回韓国石油公社債	100,000,000	100,076,000	
	第３８回関西国際空港	50,000,000	50,945,000	
	第１０回ゴールドマン・サックス・グループ・インク	200,000,000	202,612,000	
	第１７回ナショナル・オーストラリア銀行	100,000,000	100,204,000	
	第５回日揮	700,000,000	699,363,000	
	第７回明治ホールディングス	100,000,000	99,616,000	
	第３回コカ・コーラウエスト	300,000,000	302,391,000	
	第２４回味の素	100,000,000	99,647,000	
	第３回 キュービー	100,000,000	99,222,000	
	第１２回日本たばこ産業	200,000,000	199,070,000	
	第１３回日本たばこ産業	300,000,000	297,801,000	
	第６回ヒューリック	300,000,000	298,380,000	
	第７回ヒューリック	200,000,000	198,646,000	
	第２２回森ビル	200,000,000	199,408,000	
	第３１回東レ	100,000,000	99,807,000	
	第４回野村総合研究所	100,000,000	99,198,000	
	第１回電通	300,000,000	298,602,000	
	第２回電通	200,000,000	198,912,000	

第２回大塚ホールディングス	100,000,000	99,330,000	
第１１回ヤフー	300,000,000	296,139,000	
第３回富士フイルムホールディングス	100,000,000	101,905,000	
第１１回ブリヂストン	300,000,000	297,888,000	
第１３回ブリヂストン	200,000,000	198,454,000	
第１０回日本特殊陶業	100,000,000	99,281,000	
第１回日本製鉄	100,000,000	99,033,000	
第４回新日本製鐵	100,000,000	98,778,000	
第１９回豊田自動織機	100,000,000	101,455,000	
第４８回日本精工	200,000,000	199,298,000	
第５１回日本精工	100,000,000	98,581,000	
第１９回日立製作所	300,000,000	294,519,000	
第５３回日本電気	200,000,000	199,684,000	
第１５回パナソニック	300,000,000	300,240,000	
第１７回パナソニック	100,000,000	99,993,000	
第１８回デンソー	500,000,000	496,900,000	
第２９回三菱重工業	300,000,000	304,095,000	
第１回日本生命２０１７基金	100,000,000	99,795,000	
第２回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	200,000,000	199,944,000	
第６０回日産自動車	200,000,000	195,866,000	
第１３回アイシン精機	100,000,000	102,063,000	
第１回明治安田生命２０１８基金	300,000,000	298,128,000	
第１回明治安田生命２０１９基金	200,000,000	197,982,000	
第４８回クレディセゾン	200,000,000	204,522,000	
第３回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	300,000,000	298,374,000	
第１７回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	300,000,000	291,774,000	
第８回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）	100,000,000	101,951,000	
第９回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）	100,000,000	109,043,000	
第２８回三菱東京ＵＦＪ銀行（劣後特約付）	100,000,000	101,057,000	
第２９回三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付	200,000,000	215,840,000	
第３０回三菱東京ＵＦＪ銀行（劣後特約付）	100,000,000	114,465,000	
第５７回三菱東京ＵＦＪ銀行	200,000,000	210,852,000	
第８回三菱ＵＦＪ信託銀行（劣後特約付）	200,000,000	212,688,000	
第６回住友信託銀行（劣後特約付）	100,000,000	111,922,000	
第２３回三井住友銀行（劣後特約付）	100,000,000	100,953,000	
第２５回三井住友銀行（劣後特約付）	200,000,000	217,388,000	
第１５回芙蓉総合リース	100,000,000	99,071,000	
第４７回日産フィナンシャルサービス	200,000,000	195,940,000	
第２０回東京センチュリーリース	100,000,000	99,794,000	
第２３回東京センチュリーリース	200,000,000	199,298,000	
第４２回ホンダファイナンス	100,000,000	99,742,000	
第２３回リコーリース	200,000,000	199,474,000	

第２７回リコーリース	100,000,000	99,734,000	
第３０回リコーリース	200,000,000	199,744,000	
第３５回リコーリース	100,000,000	99,485,000	
第３７回リコーリース	300,000,000	297,945,000	
第７回イオンフィナンシャルサービス	200,000,000	197,442,000	
第７９回アコム	300,000,000	292,074,000	
第４７回日立キャピタル	100,000,000	101,485,000	
第７０回日立キャピタル	200,000,000	199,668,000	
第８２回日立キャピタル	300,000,000	298,002,000	
第１９４回オリックス	400,000,000	398,120,000	
第２１回三井住友ファイナンス＆リース	200,000,000	198,866,000	
第６３回三菱ＵＦＪリース	300,000,000	297,771,000	
第６６回三菱ＵＦＪリース	400,000,000	396,480,000	
第７４回三菱ＵＦＪリース	400,000,000	397,460,000	
第７５回三菱ＵＦＪリース	200,000,000	197,656,000	
第２７回野村ホールディングス	100,000,000	108,873,000	
第５０回野村ホールディングス	200,000,000	200,068,000	
第１１６回三菱地所	100,000,000	101,577,000	
第１２５回三菱地所	300,000,000	297,975,000	
第９５回住友不動産	100,000,000	102,605,000	
第９９回住友不動産	300,000,000	306,282,000	
第１２回イオンモール	200,000,000	199,830,000	
第１７回エヌ・ティ・ティ都市開発	100,000,000	101,477,000	
第１２回森トラスト総合リート投資法人	100,000,000	99,650,000	
第３６回京王電鉄	100,000,000	99,397,000	
第３８回京王電鉄	100,000,000	99,192,000	
第１９回東日本旅客鉄道	100,000,000	104,328,000	
第２６回東日本旅客鉄道	100,000,000	102,837,000	
第１００回東日本旅客鉄道	100,000,000	130,316,000	
第９回東海旅客鉄道	100,000,000	103,984,000	
第１１回東海旅客鉄道	100,000,000	102,728,000	
第５３回東海旅客鉄道	100,000,000	114,304,000	
第５６回東海旅客鉄道	100,000,000	117,872,000	
第７４回東海旅客鉄道	100,000,000	124,229,000	
第１１回東京地下鉄	100,000,000	101,809,000	
第５０回阪急阪神ホールディングス	200,000,000	198,128,000	
第１６回三菱倉庫	200,000,000	198,774,000	
第６３回日本電信電話	100,000,000	101,469,000	
第２１回ＫＤＤＩ	100,000,000	101,513,000	
第２７回ＫＤＤＩ	300,000,000	296,613,000	
第１回ソフトバンク	300,000,000	299,634,000	
第２０回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	100,000,000	101,657,000	

第５６７回東京電力	100,000,000	106,828,000	
第４９９回中部電力	50,000,000	51,603,000	
第５００回中部電力	100,000,000	102,597,000	
第５２８回中部電力	200,000,000	199,234,000	
第４９６回関西電力	100,000,000	102,576,000	
第４９９回関西電力	200,000,000	202,764,000	
第５０８回関西電力	200,000,000	199,382,000	
第５１２回関西電力	200,000,000	199,680,000	
第５１７回関西電力	300,000,000	299,469,000	
第５３２回関西電力	100,000,000	99,358,000	
第３８１回中国電力	100,000,000	102,822,000	
第３８５回中国電力	100,000,000	102,113,000	
第４０２回中国電力	200,000,000	199,726,000	
第４０９回中国電力	300,000,000	299,631,000	
第３０４回北陸電力	100,000,000	102,698,000	
第３０７回北陸電力	100,000,000	104,188,000	
第３１０回北陸電力	200,000,000	204,368,000	
第３２２回北陸電力	200,000,000	199,716,000	
第２５３回四国電力	100,000,000	102,514,000	
第４２９回九州電力	200,000,000	205,276,000	
第４８４回九州電力	300,000,000	296,547,000	
第３８回電源開発	100,000,000	102,655,000	
第３９回電源開発	100,000,000	102,466,000	
第４０回電源開発	200,000,000	205,002,000	
第５７回電源開発	200,000,000	197,690,000	
第４回東京電力パワーグリッド	400,000,000	401,960,000	
第６回東京電力パワーグリッド	100,000,000	99,560,000	
第１３回東京電力パワーグリッド	200,000,000	196,942,000	
第１５回東京電力パワーグリッド	200,000,000	196,500,000	
第２８回東京電力パワーグリッド	200,000,000	199,890,000	
第３０回東京電力パワーグリッド	100,000,000	99,791,000	
第３１回東京電力パワーグリッド	200,000,000	199,096,000	
第２３回東京ガス	200,000,000	205,360,000	
第１３回広島ガス	200,000,000	198,702,000	
第６回ＳＣＳＫ	100,000,000	99,687,000	
第４回ファーストリテイリング	100,000,000	102,074,000	
第７回ファーストリテイリング	200,000,000	198,280,000	
社債券 合計	26,400,000,000	26,586,794,000	
合計	530,409,255,000	573,522,043,989	

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
[令和 2年 3月25日現在]	
資産の部	
流動資産	
預金	313,081,992
コール・ローン	1,976,547,484
国債証券	190,184,290,785
派生商品評価勘定	1,873,757,324
未収入金	50,700,196,881
未収利息	1,655,381,395
前払費用	119,884,852
流動資産合計	246,823,140,713
資産合計	246,823,140,713
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,212,236,039
未払金	526,016,160
未払解約金	26,399,580,641
未払利息	1,005
流動負債合計	29,137,833,845
負債合計	29,137,833,845
純資産の部	
元本等	
元本	157,300,804,828
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	60,384,502,040
元本等合計	217,685,306,868
純資産合計	217,685,306,868
負債純資産合計	246,823,140,713

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 2年 3月25日現在]
1. 期首	平成31年 3月26日
期首元本額	180,826,716,827円
期中追加設定元本額	42,819,774,648円
期中一部解約元本額	66,345,686,647円
元本の内訳	
e M A X I S 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）	124,754,757円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	5,213,992,468円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	5,246,052,503円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	2,040,452,704円
三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）	1,557,513,835円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	3,004,951,561円
e M A X I S 債券バランス（２資産均等型）	73,607,066円
M U A M ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家 転売制限付）	84,213,834,590円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,334,341,057円
アドバンスト・バランス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	76,119,162円
アドバンスト・バランス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	89,342,059円
M U K A M バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関 投資家転売制限付）	9,122,928,092円
M U K A M バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機 関投資家転売制限付）	3,775,964,683円
M U K A M スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資 家転売制限付）	3,947,170,343円
M U K A M 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家 限定）	8,744,115,549円
M U K A M バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関 投資家転売制限付）	526,079,478円
M U K A M ヘッジ付外国債券インデックスファンド２（適格機関 投資家限定）	5,952,904,501円
M U K A M ヘッジ付外国債券インデックスオープン（適格機関投 資家限定）	7,561,168,984円
M U K A M スマート・クオリティ・セレクション２（適格機関投 資家限定）	3,751,502,154円
M U K A M バランスファンド２０１９－１２（適格機関投資家限 定）	1,944,009,282円
合計	157,300,804,828円
2. 受益権の総数	157,300,804,828口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成31年 3月26日 至 令和 2年 3月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 2年 3月25日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[令和 2年 3月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	4,120,205,374
合計	4,120,205,374

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[令和 2年 3月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカドル	119,502,201,520	—	121,588,141,100	2,085,939,580
	カナダドル	4,577,762,200	—	4,410,081,000	167,681,200
	オーストラリアドル	4,558,845,419	—	4,294,764,500	264,080,919
	イギリスポンド	15,430,146,317	—	14,622,882,200	807,264,117
	シンガポールドル	1,592,421,715	—	1,573,913,200	18,508,515
	スウェーデンクローネ	674,119,690	—	663,960,600	10,159,090
	ノルウェークローネ	560,268,690	—	496,896,400	63,372,290
	デンマーククローネ	1,274,923,372	—	1,280,624,400	5,701,028
	メキシコペソ	1,949,426,490	—	1,617,708,500	331,717,990
	ポーランドズロチ	1,425,181,956	—	1,366,854,800	58,327,156
	南アフリカランド	1,260,312,490	—	1,165,088,900	95,223,590
	ユーロ	89,089,591,226	—	89,152,764,200	63,172,974
合計		241,895,201,085	—	242,233,679,800	338,478,715

（注）時価の算定方法

- 1 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

（イ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

（ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[令和 2年 3月25日現在]
1口当たり純資産額	1.3839円
(1万口当たり純資産額)	(13,839円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表
(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨	種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
アメリカ ドル	国債証券	1.125 T-NOTE 210228	3,100,000.00	3,126,398.43	
		1.125 T-NOTE 210731	2,600,000.00	2,627,015.62	
		1.125 T-NOTE 210831	2,800,000.00	2,829,531.25	
		1.125 T-NOTE 210930	700,000.00	707,929.68	
		1.25 T-NOTE 210331	5,400,000.00	5,455,265.62	
		1.25 T-NOTE 211031	3,100,000.00	3,143,351.56	
		1.375 T-NOTE 210430	7,000,000.00	7,085,312.50	
		1.375 T-NOTE 210531	2,500,000.00	2,531,835.93	
		1.375 T-NOTE 221015	8,000,000.00	8,194,062.49	
		1.375 T-NOTE 230630	4,100,000.00	4,217,234.37	
		1.375 T-NOTE 230831	3,700,000.00	3,811,578.12	
		1.375 T-NOTE 230930	7,000,000.00	7,213,828.12	
		1.5 T-NOTE 220131	800,000.00	816,250.00	
		1.5 T-NOTE 220815	5,500,000.00	5,643,730.46	
		1.5 T-NOTE 230115	11,000,000.00	11,331,289.05	
		1.5 T-NOTE 230228	6,300,000.00	6,493,921.87	
		1.5 T-NOTE 230331	6,700,000.00	6,906,757.81	
		1.5 T-NOTE 241031	6,000,000.00	6,271,406.25	
		1.5 T-NOTE 260815	8,300,000.00	8,711,109.37	

1.5 T-NOTE 270131	8,200,000.00	8,622,812.50	
1.625 T-NOTE 220815	8,400,000.00	8,639,859.37	
1.625 T-NOTE 221115	12,150,000.00	12,532,060.53	
1.625 T-NOTE 230430	7,850,000.00	8,133,335.93	
1.625 T-NOTE 230531	4,900,000.00	5,079,539.06	
1.625 T-NOTE 231031	6,700,000.00	6,974,281.25	
1.625 T-NOTE 260215	8,800,000.00	9,286,750.00	
1.625 T-NOTE 260515	9,200,000.00	9,711,031.25	
1.625 T-NOTE 260930	4,500,000.00	4,766,835.93	
1.625 T-NOTE 261031	5,000,000.00	5,294,921.87	
1.625 T-NOTE 261130	5,200,000.00	5,508,343.74	
1.625 T-NOTE 290815	7,900,000.00	8,477,070.31	
1.75 T-NOTE 211130	6,600,000.00	6,750,046.87	
1.75 T-NOTE 220228	1,750,000.00	1,795,527.34	
1.75 T-NOTE 220331	4,400,000.00	4,518,593.74	
1.75 T-NOTE 220430	3,100,000.00	3,187,187.50	
1.75 T-NOTE 220515	9,200,000.00	9,470,968.75	
1.75 T-NOTE 220531	3,800,000.00	3,907,765.62	
1.75 T-NOTE 220715	4,000,000.00	4,121,406.24	
1.75 T-NOTE 220930	4,900,000.00	5,061,929.68	
1.75 T-NOTE 240731	8,000,000.00	8,433,750.00	
1.75 T-NOTE 261231	6,800,000.00	7,262,187.50	
1.875 T-NOTE 211130	2,700,000.00	2,767,921.87	
1.875 T-NOTE 220131	2,000,000.00	2,054,531.25	
1.875 T-NOTE 220228	12,500,000.00	12,853,515.62	
1.875 T-NOTE 220430	12,000,000.00	12,368,437.50	
1.875 T-NOTE 220531	3,700,000.00	3,815,625.00	
1.875 T-NOTE 220831	3,750,000.00	3,883,593.75	
1.875 T-NOTE 221031	6,300,000.00	6,537,726.56	
2 T-BOND 500215	1,850,000.00	2,140,652.34	
2 T-NOTE 210228	4,800,000.00	4,879,312.49	
2 T-NOTE 210831	1,000,000.00	1,023,085.93	
2 T-NOTE 211031	3,800,000.00	3,897,968.75	
2 T-NOTE 220215	8,900,000.00	9,167,347.65	
2 T-NOTE 221130	10,700,000.00	11,146,390.62	
2 T-NOTE 230215	8,900,000.00	9,300,500.00	
2 T-NOTE 240430	2,500,000.00	2,650,195.31	
2 T-NOTE 240531	12,000,000.00	12,749,062.50	
2 T-NOTE 250215	7,000,000.00	7,492,734.37	
2 T-NOTE 250815	12,300,000.00	13,210,007.81	
2 T-NOTE 261115	7,300,000.00	7,911,375.00	
2.125 T-NOTE 210815	6,400,000.00	6,554,749.99	

2.125 T-NOTE 210930	1,000,000.00	1,026,171.87
2.125 T-NOTE 211231	3,700,000.00	3,811,867.18
2.125 T-NOTE 220630	6,350,000.00	6,595,566.40
2.125 T-NOTE 221231	8,500,000.00	8,896,445.31
2.125 T-NOTE 231130	7,700,000.00	8,160,195.31
2.125 T-NOTE 240229	2,700,000.00	2,870,226.56
2.125 T-NOTE 240331	4,600,000.00	4,902,234.37
2.125 T-NOTE 241130	6,300,000.00	6,763,148.42
2.25 T-BOND 460815	3,150,000.00	3,783,322.26
2.25 T-NOTE 210331	1,800,000.00	1,836,773.43
2.25 T-NOTE 210430	6,100,000.00	6,234,390.62
2.25 T-NOTE 210731	700,000.00	717,828.12
2.25 T-NOTE 231231	8,800,000.00	9,376,812.50
2.25 T-NOTE 241031	1,400,000.00	1,509,921.87
2.25 T-NOTE 241231	5,100,000.00	5,511,585.93
2.25 T-NOTE 251115	7,000,000.00	7,622,343.75
2.25 T-NOTE 260331	7,000,000.00	7,661,718.75
2.25 T-NOTE 270815	6,500,000.00	7,208,906.25
2.25 T-NOTE 271115	5,000,000.00	5,553,906.25
2.375 T-BOND 491115	6,000,000.00	7,434,374.99
2.375 T-NOTE 210315	7,000,000.00	7,146,835.93
2.375 T-NOTE 240229	10,000,000.00	10,736,718.75
2.375 T-NOTE 240815	9,200,000.00	9,944,625.00
2.375 T-NOTE 270515	9,800,000.00	10,935,421.87
2.5 T-BOND 450215	5,050,000.00	6,295,140.62
2.5 T-BOND 460215	5,100,000.00	6,397,910.15
2.5 T-BOND 460515	5,250,000.00	6,586,083.98
2.5 T-NOTE 230815	9,050,000.00	9,665,824.21
2.5 T-NOTE 240515	9,100,000.00	9,847,195.31
2.5 T-NOTE 250131	2,000,000.00	2,187,500.00
2.625 T-NOTE 210515	7,000,000.00	7,188,671.87
2.625 T-NOTE 210615	3,000,000.00	3,085,546.87
2.625 T-NOTE 211215	9,000,000.00	9,345,585.93
2.625 T-NOTE 230630	5,600,000.00	5,990,687.50
2.625 T-NOTE 250331	1,600,000.00	1,764,125.00
2.625 T-NOTE 290215	8,800,000.00	10,172,250.00
2.75 T-BOND 420815	1,650,000.00	2,124,375.00
2.75 T-BOND 421115	2,000,000.00	2,580,937.50
2.75 T-BOND 471115	3,600,000.00	4,738,078.12
2.75 T-NOTE 230531	3,000,000.00	3,216,562.50
2.75 T-NOTE 231115	8,800,000.00	9,515,000.00
2.75 T-NOTE 240215	3,000,000.00	3,262,031.25
2.75 T-NOTE 250630	1,500,000.00	1,669,687.50

2.75 T-NOTE 250831	5,000,000.00	5,575,000.00	
2.875 T-BOND 450815	6,100,000.00	8,133,253.90	
2.875 T-BOND 490515	4,200,000.00	5,677,054.68	
2.875 T-NOTE 211015	1,500,000.00	1,557,714.84	
2.875 T-NOTE 231031	8,500,000.00	9,223,164.06	
2.875 T-NOTE 250430	9,400,000.00	10,499,359.37	
2.875 T-NOTE 250731	6,000,000.00	6,727,968.75	
2.875 T-NOTE 280515	5,000,000.00	5,828,125.00	
2.875 T-NOTE 280815	8,900,000.00	10,405,351.56	
3 T-BOND 420515	4,670,000.00	6,252,509.76	
3 T-BOND 441115	3,400,000.00	4,594,250.00	
3 T-BOND 450515	6,000,000.00	8,144,296.87	
3 T-BOND 451115	3,450,000.00	4,708,171.87	
3 T-BOND 470215	3,810,000.00	5,257,353.50	
3 T-BOND 480215	5,700,000.00	7,859,988.27	
3 T-BOND 480815	5,600,000.00	7,718,156.24	
3 T-BOND 490215	6,100,000.00	8,428,246.09	
3.125 T-BOND 411115	2,500,000.00	3,402,832.03	
3.125 T-BOND 420215	4,300,000.00	5,862,781.25	
3.125 T-BOND 430215	3,600,000.00	4,920,187.50	
3.125 T-BOND 440815	6,600,000.00	9,086,085.93	
3.125 T-BOND 480515	4,100,000.00	5,772,671.87	
3.125 T-NOTE 210515	1,300,000.00	1,341,742.18	
3.125 T-NOTE 281115	14,900,000.00	17,796,187.50	
3.375 T-BOND 440515	1,650,000.00	2,357,953.12	
3.375 T-BOND 481115	6,000,000.00	8,835,000.00	
3.5 T-BOND 390215	2,000,000.00	2,833,750.00	
3.625 T-BOND 430815	3,000,000.00	4,420,312.50	
3.625 T-BOND 440215	6,200,000.00	9,167,039.05	
3.75 T-BOND 410815	1,000,000.00	1,480,117.18	
3.875 T-BOND 400815	800,000.00	1,196,093.74	
4.375 T-BOND 380215	940,000.00	1,460,818.75	
4.375 T-BOND 391115	1,190,000.00	1,879,828.12	
4.375 T-BOND 410515	1,100,000.00	1,758,839.84	
4.5 T-BOND 360215	2,200,000.00	3,364,367.18	
4.5 T-BOND 380515	1,300,000.00	2,049,531.25	
4.625 T-BOND 400215	1,800,000.00	2,934,351.55	
4.75 T-BOND 410215	1,700,000.00	2,830,699.21	
5 T-BOND 370515	1,050,000.00	1,719,826.17	
5.375 T-BOND 310215	1,580,000.00	2,325,068.75	
6 T-BOND 260215	2,000,000.00	2,621,875.00	
6.125 T-BOND 271115	7,500,000.00	10,512,597.65	

		6.25 T-BOND 230815	3,000,000.00	3,584,531.25		
		6.25 T-BOND 300515	1,300,000.00	1,986,968.75		
		8 T-BOND 211115	1,300,000.00	1,462,347.65		
アメリカドル合計			775,090,000.00	868,487,652.52 (96,541,087,454)		
カナダドル	国債証券	0.5 CAN GOVT 220301	1,200,000.00	1,196,916.00		
		0.75 CAN GOVT 210301	5,900,000.00	5,907,729.00		
		0.75 CAN GOVT 210901	150,000.00	150,252.00		
		1 CAN GOVT 220901	6,000,000.00	6,052,920.00		
		1 CAN GOVT 270601	1,500,000.00	1,523,895.00		
		1.5 CAN GOVT 230601	3,250,000.00	3,333,427.50		
		1.5 CAN GOVT 260601	1,650,000.00	1,723,672.50		
		1.75 CAN GOVT 230301	1,000,000.00	1,031,280.00		
		2 CAN GOVT 280601	1,500,000.00	1,644,015.00		
		2 CAN GOVT 511201	500,000.00	590,155.00		
		2.25 CAN GOVT 240301	1,200,000.00	1,273,044.00		
		2.5 CAN GOVT 240601	2,200,000.00	2,362,866.00		
		2.75 CAN GOVT 220601	3,000,000.00	3,137,700.00		
		2.75 CAN GOVT 481201	950,000.00	1,278,795.00		
		2.75 CANADA GOVER 641201	800,000.00	1,199,176.00		
		3.25 CAN GOVT 210601	3,100,000.00	3,195,387.00		
		3.5 CAN GOVT 451201	1,050,000.00	1,553,191.50		
		4 CAN GOVT 410601	1,690,000.00	2,554,958.90		
		5 CAN GOVT 370601	1,450,000.00	2,321,537.00		
		5.75 CAN GOVT 290601	950,000.00	1,359,022.50		
		5.75 CAN GOVT 330601	1,800,000.00	2,846,214.00		
		8 CAN GOVT 270601	1,550,000.00	2,327,650.50		
カナダドル合計			42,390,000.00	48,563,804.40 (3,733,099,644)		
オーストラリアドル	国債証券	2 AUST GOVT 211221	2,450,000.00	2,522,786.07		
		2.25 AUST GOVT 221121	800,000.00	841,312.32		
		2.25 AUST GOVT 280521	3,300,000.00	3,683,181.15		
		2.5 AUST GOVT 300521	4,050,000.00	4,678,491.15		
		2.75 AUST GOVT 240421	2,400,000.00	2,630,069.04		
		2.75 AUST GOVT 281121	3,050,000.00	3,539,577.46		
		2.75 AUST GOVT 291121	2,950,000.00	3,458,812.75		
		2.75 AUST GOVT 350621	1,000,000.00	1,194,531.70		
		3 AUST GOVT 470321	1,680,000.00	2,120,260.12		
		3.25 AUST GOVT 250421	3,550,000.00	4,047,792.00		
		3.25 AUST GOVT 290421	1,500,000.00	1,811,617.80		
		3.25 AUST GOVT 390621	900,000.00	1,148,445.27		
		4.25 AUST GOVT 260421	3,250,000.00	3,970,810.67		
		4.5 AUST GOVT 330421	2,100,000.00	2,973,552.96		

		4.75 AUST GOVT 270421	3,500,000.00	4,501,637.00	
		5.5 AUST GOVT 230421	2,600,000.00	3,012,505.34	
		5.75 AUST GOVT 210515	3,900,000.00	4,141,798.83	
		5.75 AUST GOVT 220715	2,900,000.00	3,263,112.48	
オーストラリアドル合計			45,880,000.00	53,540,294.11 (3,545,438,275)	
イギリス ポンド	国債証券	0.5 GILT 220722	3,380,000.00	3,411,398.84	
		0.75 GILT 230722	2,650,000.00	2,703,266.59	
		0.875 GILT 291022	800,000.00	835,474.56	
		1 GILT 240422	1,200,000.00	1,239,861.60	
		1.25 GILT 270722	4,880,000.00	5,227,016.80	
		1.5 GILT 260722	2,850,000.00	3,080,364.36	
		1.625 GILT 281022	2,100,000.00	2,333,177.28	
		1.625 GILT 711022	1,370,000.00	2,036,288.54	
		1.75 GILT 220907	2,950,000.00	3,067,553.96	
		1.75 GILT 370907	2,570,000.00	2,981,680.07	
		1.75 GILT 490122	1,590,000.00	1,956,495.00	
		1.75 GILT 570722	2,170,000.00	2,946,381.51	
		2.25 GILT 230907	3,650,000.00	3,914,084.07	
		2.5 GILT 650722	1,830,000.00	3,170,193.18	
		2.75 GILT 240907	1,300,000.00	1,447,502.16	
		3.25 GILT 440122	1,240,000.00	1,878,302.40	
		3.5 GILT 450122	2,670,000.00	4,248,306.42	
		3.5 GILT 680722	540,000.00	1,192,553.06	
		3.75 GILT 520722	1,310,000.00	2,441,180.27	
		4 GILT 220307	1,650,000.00	1,774,971.00	
		4 GILT 600122	1,900,000.00	4,137,858.00	
		4.25 GILT 271207	850,000.00	1,105,335.58	
		4.25 GILT 320607	1,550,000.00	2,216,221.00	
		4.25 GILT 360307	1,800,000.00	2,764,232.28	
		4.25 GILT 390907	1,650,000.00	2,686,774.20	
		4.25 GILT 401207	1,910,000.00	3,163,282.79	
		4.25 GILT 461207	1,900,000.00	3,444,693.16	
		4.25 GILT 491207	1,130,000.00	2,148,027.17	
		4.25 GILT 551207	1,410,000.00	3,005,994.51	
		4.5 GILT 340907	1,300,000.00	1,986,461.10	
		4.5 GILT 421207	2,350,000.00	4,136,367.07	
		4.75 GILT 301207	1,800,000.00	2,603,563.56	
		4.75 GILT 381207	1,550,000.00	2,638,780.76	
		5 GILT 250307	3,330,000.00	4,112,242.30	
		6 GILT 281207	1,170,000.00	1,740,772.80	
		8 GILT 210607	700,000.00	766,325.00	

イギリスポンド合計			69,000,000.00	94,542,982.95 (12,370,003,889)	
シンガ ポールド ル	国債証券	1.25 SINGAPORGOVT 211001	150,000.00	150,569.25	
		1.75 SINGAPORGOVT 220401	650,000.00	659,100.00	
		2.25 SINGAPORGOVT 210601	1,150,000.00	1,166,911.32	
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	1,150,000.00	1,240,850.00	
		2.375 SINGAPORGOV 250601	1,000,000.00	1,052,000.00	
		2.625 SINGAPORGOV 280501	1,000,000.00	1,086,000.00	
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	1,400,000.00	1,471,960.00	
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	300,000.00	357,600.00	
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	900,000.00	1,091,700.00	
		2.875 SINGAPORGOV 290701	450,000.00	501,288.75	
		2.875SINGAPORGOVT 300901	800,000.00	898,400.00	
		3 SINGAPORGOVT 240901	2,650,000.00	2,850,631.50	
		3.125SINGAPORGOVT 220901	1,200,000.00	1,258,800.00	
		3.375 SINGAPORGOV 330901	1,200,000.00	1,447,704.00	
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	1,620,000.00	1,837,080.00	
シンガポールドル合計			15,620,000.00	17,070,594.82 (1,308,973,210)	
スウェー デンク ローネ	国債証券	0.75 SWD GOVT 280512	5,600,000.00	5,982,608.24	
		0.75 SWD GOVT 291112	4,500,000.00	4,829,940.00	
		1 SWD GOVT 261112	6,150,000.00	6,622,922.70	
		1.5 SWD GOVT 231113	1,800,000.00	1,920,363.84	
		2.5 SWD GOVT 250512	7,200,000.00	8,232,177.60	
		3.5 SWD GOVT 220601	11,550,000.00	12,537,201.60	
		3.5 SWD GOVT 390330	3,700,000.00	5,868,755.00	
スウェーデンクローネ合計			40,500,000.00	45,993,968.98 (505,473,719)	
ノル ウェーク ローネ	国債証券	1.375 NORWE GOVT 300819	1,900,000.00	1,961,009.00	
		1.5 NORWE GOVT 260219	2,850,000.00	2,971,467.00	
		1.75 NORWE GOVT 250313	4,800,000.00	5,071,529.76	
		1.75 NORWE GOVT 270217	4,250,000.00	4,523,745.90	
		1.75 NORWE GOVT 290906	3,000,000.00	3,201,435.00	
		2 NORWE GOVT 230524	7,250,000.00	7,609,629.00	
		2 NORWE GOVT 280426	2,550,000.00	2,756,652.00	
		3 NORWE GOVT 240314	4,950,000.00	5,427,467.10	
		3.75 NORWE GOVT 210525	10,200,000.00	10,625,136.00	
ノルウェークローネ合計			41,750,000.00	44,148,070.76 (442,363,669)	
デンマー ククロー ネ	国債証券	0.5 DMK GOVT 271115	8,200,000.00	8,675,149.00	
		0.5 DMK GOVT 291115	6,000,000.00	6,358,740.00	
		1.5 DMK GOVT 231115	8,100,000.00	8,688,043.80	

		1.75 DMK GOVT 251115	7,600,000.00	8,496,192.00	
		3 DMK GOVT 211115	12,650,000.00	13,390,151.50	
		4.5 DMK GOVT 391115	10,400,000.00	19,403,904.00	
デンマーククローネ合計			52,950,000.00	65,012,180.30 (1,044,745,737)	
メキシコ ペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	34,750,000.00	38,518,985.00	
		10 MEXICAN BONOS 361120	9,000,000.00	10,507,590.00	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	21,350,000.00	19,537,598.50	
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	29,150,000.00	29,103,068.50	
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	35,000,000.00	34,807,500.00	
		7.25 MEXICAN BONO 211209	10,000,000.00	10,100,000.00	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	15,750,000.00	15,560,685.00	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	5,800,000.00	5,658,306.00	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	24,100,000.00	21,964,258.00	
		8 MEXICAN BONOS 231207	21,500,000.00	22,179,400.00	
		8 MEXICAN BONOS 240905	15,000,000.00	15,474,600.00	
		8 MEXICAN BONOS 471107	15,000,000.00	13,878,150.00	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	24,400,000.00	25,434,072.00	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	18,200,000.00	18,165,056.00	
メキシコペソ合計			279,000,000.00	280,889,269.00 (1,252,766,139)	
ポーランド ズロチ	国債証券	2.5 POLAND 230125	800,000.00	835,729.84	
		2.5 POLAND 240425	6,000,000.00	6,387,372.60	
		2.5 POLAND 260725	3,500,000.00	3,699,113.95	
		2.5 POLAND 270725	1,500,000.00	1,587,554.40	
		2.75 POLAND 280425	3,700,000.00	3,967,467.82	
		2.75 POLAND 291025	1,000,000.00	1,079,706.60	
		3.25 POLAND 250725	3,550,000.00	3,898,664.31	
		4 POLAND 231025	4,150,000.00	4,597,411.50	
		5.75 POLAND 211025	1,900,000.00	2,047,174.00	
		5.75 POLAND 220923	2,500,000.00	2,799,975.00	
		5.75 POLAND 290425	1,400,000.00	1,853,950.00	
		POLAND 220725	5,000,000.00	4,890,933.15	
ポーランドズロチ合計			35,000,000.00	37,645,053.17 (979,900,734)	
南アフリ カランド	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	8,400,000.00	8,087,862.38	
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	4,700,000.00	2,521,706.55	
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	17,900,000.00	9,102,150.00	
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	5,800,000.00	5,761,166.44	
		7 SOUTH AFRICA 310228	18,000,000.00	12,024,345.60	
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	8,200,000.00	8,194,450.81	
		8 SOUTH AFRICA 300131	15,200,000.00	11,460,310.56	

		8.25 SOUTH AFRICA 320331	7,800,000.00	5,584,937.82	
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	20,250,000.00	13,948,927.38	
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	11,100,000.00	7,263,028.81	
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	23,200,000.00	15,548,189.22	
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	15,600,000.00	11,428,882.29	
		9 SOUTH AFRICA 400131	7,200,000.00	4,925,905.12	
南アフリカランド合計			163,350,000.00	115,851,862.98	
				(733,342,292)	
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 230715	1,400,000.00	1,413,342.00	
		0 BUND 260815	3,200,000.00	3,300,374.40	
		0 BUND 500815	770,000.00	759,112.20	
		0 FINNISH GOVT 220415	500,000.00	504,859.00	
		0 FINNISH GOVT 230915	650,000.00	656,922.50	
		0 NETH GOVT 220115	900,000.00	908,909.55	
		0 O.A.T 210525	4,800,000.00	4,827,235.20	
		0 O.A.T 220525	4,100,000.00	4,139,951.22	
		0 O.A.T 230325	2,900,000.00	2,934,060.50	
		0 OBL 211008	3,500,000.00	3,535,350.00	
		0 OBL 220408	800,000.00	810,611.60	
		0 OBL 231013	1,500,000.00	1,533,295.50	
		0 SCHATS 211210	2,000,000.00	2,022,482.00	
		0.05 ITALY GOVT 210415	3,500,000.00	3,487,232.00	
		0.125 FINNISH GOV 360415	300,000.00	291,623.10	
		0.2 BEL GOVT 231022	1,900,000.00	1,933,100.09	
		0.25 BUND 270215	2,300,000.00	2,415,901.60	
		0.25 BUND 280815	1,500,000.00	1,585,047.00	
		0.25 NETH GOVT 250715	1,150,000.00	1,185,482.10	
		0.25 O.A.T 261125	4,700,000.00	4,776,929.60	
		0.35 ITALY GOVT 211101	400,000.00	399,336.00	
		0.35 ITALY GOVT 250201	3,200,000.00	3,099,020.80	
		0.35 SPAIN GOVT 230730	1,500,000.00	1,510,414.50	
		0.4 BEL GOVT 400622	800,000.00	756,998.40	
		0.4 SPAIN GOVT 220430	3,150,000.00	3,186,271.62	
		0.45 ITALY GOVT 210601	1,950,000.00	1,950,530.40	
		0.45 SPAIN GOVT 221031	1,500,000.00	1,519,080.00	
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	400,000.00	413,414.00	
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	1,300,000.00	1,346,075.90	
		0.5 BEL GOVT 241022	1,800,000.00	1,853,139.60	
		0.5 BUND 250215	3,050,000.00	3,207,279.35	
		0.5 BUND 260215	2,400,000.00	2,542,795.20	
		0.5 BUND 280215	3,300,000.00	3,548,721.00	
		0.5 FINNISH GOVT 260415	700,000.00	724,896.90	

0.5 FINNISH GOVT 270915	500,000.00	518,079.00	
0.5 FINNISH GOVT 280915	450,000.00	466,299.00	
0.5 NETH GOVT 260715	2,000,000.00	2,096,148.40	
0.5 NETH GOVT 400115	950,000.00	1,019,188.50	
0.5 O.A.T 250525	4,100,000.00	4,241,146.60	
0.5 O.A.T 260525	5,300,000.00	5,479,034.00	
0.5 O.A.T 290525	3,930,000.00	4,058,605.32	
0.65 ITALY GOVT 231015	1,700,000.00	1,695,102.30	
0.75 AUSTRIA GOVT 261020	950,000.00	993,874.80	
0.75 AUSTRIA GOVT 280220	1,450,000.00	1,526,874.65	
0.75 FINNISH GOVT 310415	450,000.00	478,849.95	
0.75 NETH GOVT 270715	2,100,000.00	2,246,015.10	
0.75 O.A.T 281125	4,250,000.00	4,485,875.00	
0.75 O.A.T 520525	980,000.00	953,003.94	
0.8 BEL GOVT 270622	1,350,000.00	1,420,158.15	
0.8 BEL GOVT 280622	2,100,000.00	2,217,753.30	
0.875 FINNISH GOV 250915	100,000.00	105,457.60	
0.9 IRISH GOVT 280515	400,000.00	420,997.36	
0.95 ITALY GOVT 230315	2,500,000.00	2,521,615.00	
1 BEL GOVT 260622	1,300,000.00	1,379,567.80	
1 BEL GOVT 310622	1,200,000.00	1,291,915.20	
1 BUND 240815	3,600,000.00	3,849,573.96	
1 BUND 250815	2,700,000.00	2,924,867.34	
1 IRISH GOVT 260515	1,250,000.00	1,313,582.50	
1 O.A.T 251125	2,600,000.00	2,763,230.60	
1 O.A.T 270525	1,100,000.00	1,175,262.00	
1.1 IRISH GOVT 290515	950,000.00	1,018,498.80	
1.25 BEL GOVT 330422	850,000.00	945,911.45	
1.25 BUND 480815	2,000,000.00	2,693,284.00	
1.25 ITALY GOVT 261201	2,100,000.00	2,104,389.00	
1.25 O.A.T 360525	3,510,000.00	3,916,738.44	
1.3 IRISH GOVT 330515	200,000.00	220,548.60	
1.35 ITALY GOVT 220415	850,000.00	863,758.95	
1.375 FINNISH GOV 470415	350,000.00	435,457.57	
1.4 SPAIN GOVT 280730	2,400,000.00	2,528,635.20	
1.45 BEL GOVT 370622	250,000.00	285,713.00	
1.45 ITALY GOVT 220915	450,000.00	459,373.50	
1.45 ITALY GOVT 241115	1,800,000.00	1,838,001.60	
1.45 ITALY GOVT 360301	700,000.00	654,920.00	
1.45 SPAIN GOVT 271031	3,950,000.00	4,164,251.95	
1.45 SPAIN GOVT 290430	1,800,000.00	1,901,462.40	
1.5 AUSTRIA GOVT 470220	750,000.00	943,781.47	

1.5 AUSTRIA GOVT 861102	250,000.00	337,026.25
1.5 BUND 220904	2,800,000.00	2,948,722.00
1.5 BUND 230215	3,300,000.00	3,505,979.40
1.5 FINNISH GOVT 230415	550,000.00	580,921.55
1.5 IRISH GOVT 500515	400,000.00	456,396.80
1.5 ITALY GOVT 250601	2,980,000.00	3,041,008.05
1.5 O.A.T 310525	5,100,000.00	5,796,680.40
1.5 O.A.T 500525	870,000.00	1,028,992.50
1.5 SPAIN GOVT 270430	3,450,000.00	3,648,757.95
1.6 BEL GOVT 470622	330,000.00	395,603.01
1.6 ITALY GOVT 260601	2,100,000.00	2,150,883.00
1.6 SPAIN GOVT 250430	2,350,000.00	2,493,526.25
1.625 FINNISH GOV 220915	550,000.00	577,410.35
1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1,100,000.00	1,192,664.00
1.7 IRISH GOVT 370515	650,000.00	757,939.65
1.75 AUSTRIA GOVT 231020	2,000,000.00	2,147,392.00
1.75 BUND 220704	2,750,000.00	2,900,961.25
1.75 BUND 240215	1,950,000.00	2,129,312.64
1.75 NETH GOVT 230715	3,200,000.00	3,440,048.00
1.75 O.A.T 230525	4,900,000.00	5,232,322.90
1.75 O.A.T 241125	4,400,000.00	4,805,077.20
1.75 O.A.T 660525	1,660,000.00	2,188,062.60
1.85 ITALY GOVT 240515	1,000,000.00	1,038,750.00
1.9 BEL GOVT 380622	1,200,000.00	1,469,125.20
1.95 SPAIN GOVT 260430	2,500,000.00	2,716,127.50
1.95 SPAIN GOVT 300730	2,900,000.00	3,200,796.99
2 BUND 220104	3,400,000.00	3,562,129.34
2 BUND 230815	3,100,000.00	3,378,770.60
2 FINNISH GOVT 240415	1,050,000.00	1,147,601.70
2 IRISH GOVT 450218	1,000,000.00	1,272,627.50
2 ITALY GOVT 251201	3,450,000.00	3,613,109.10
2 ITALY GOVT 280201	950,000.00	995,822.30
2 NETH GOVT 240715	2,200,000.00	2,432,108.14
2 O.A.T 480525	3,000,000.00	3,920,793.00
2.1 AUSTRIA GOVT 170920	550,000.00	946,882.20
2.15 BEL GOVT 660622	880,000.00	1,261,618.16
2.15 ITALY GOVT 211215	2,600,000.00	2,672,878.00
2.15 SPAIN GOVT 251031	2,000,000.00	2,186,900.00
2.2 ITALY GOVT 270601	2,200,000.00	2,334,413.40
2.25 BEL GOVT 230622	800,000.00	867,284.48
2.25 BEL GOVT 570622	620,000.00	878,617.50
2.25 BUND 210904	250,000.00	260,379.00
2.25 ITALY GOVT 360901	750,000.00	781,110.90

2.25 NETH GOVT 220715	1,550,000.00	1,650,523.70	
2.25 O.A.T 221025	6,000,000.00	6,420,012.00	
2.25 O.A.T 240525	4,450,000.00	4,921,380.93	
2.35 SPAIN GOVT 330730	1,770,000.00	2,052,710.59	
2.4 AUSTRIA GOVT 340523	900,000.00	1,162,102.50	
2.4 IRISH GOVT 300515	1,190,000.00	1,430,542.43	
2.45 ITALY GOVT 330901	2,150,000.00	2,318,338.55	
2.5 BUND 440704	2,900,000.00	4,698,814.90	
2.5 BUND 460815	2,830,000.00	4,698,646.17	
2.5 ITALY GOVT 241201	3,000,000.00	3,201,750.00	
2.5 ITALY GOVT 251115	3,200,000.00	3,436,844.80	
2.5 NETH GOVT 330115	1,500,000.00	1,984,962.00	
2.5 O.A.T 300525	5,800,000.00	7,144,579.20	
2.625 FINNISH GOV 420704	550,000.00	819,143.43	
2.7 ITALY GOVT 470301	2,700,000.00	2,882,962.80	
2.75 FINNISH GOVT 280704	540,000.00	660,790.44	
2.75 NETH GOVT 470115	1,430,000.00	2,389,217.83	
2.75 O.A.T 271025	4,700,000.00	5,664,017.00	
2.75 SPAIN GOVT 241031	3,000,000.00	3,327,405.00	
2.8 ITALY GOVT 281201	2,450,000.00	2,712,444.00	
2.8 ITALY GOVT 670301	1,650,000.00	1,751,308.68	
2.9 SPAIN GOVT 461031	2,450,000.00	3,181,692.50	
2.95 ITALY GOVT 380901	2,400,000.00	2,710,500.00	
3 BEL GOVT 340622	1,200,000.00	1,624,866.00	
3 O.A.T 220425	3,000,000.00	3,216,858.00	
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	550,000.00	902,292.60	
3.25 BUND 210704	1,800,000.00	1,889,109.00	
3.25 BUND 420704	700,000.00	1,227,455.60	
3.25 O.A.T 211025	4,050,000.00	4,291,299.00	
3.25 O.A.T 450525	2,940,000.00	4,641,777.84	
3.35 ITALY GOVT 350301	500,000.00	593,214.00	
3.4 IRISH GOVT 240318	750,000.00	852,337.50	
3.45 ITALY GOVT 480301	2,270,000.00	2,745,814.70	
3.45 SPAIN GOVT 660730	1,200,000.00	1,839,484.80	
3.5 AUSTRIA GOVT 210915	1,600,000.00	1,694,544.00	
3.5 FINNISH GOVT 210415	200,000.00	208,543.60	
3.5 ITALY GOVT 300301	3,000,000.00	3,515,520.00	
3.5 O.A.T 260425	3,200,000.00	3,891,438.40	
3.65 AUSTRIA GOVT 220420	1,250,000.00	1,355,506.25	
3.75 BEL GOVT 450622	550,000.00	931,339.75	
3.75 ITALY GOVT 210501	3,950,000.00	4,094,086.12	
3.75 ITALY GOVT 210801	2,300,000.00	2,400,673.76	

3.75 ITALY GOVT 240901	2,100,000.00	2,351,189.40
3.75 NETH GOVT 230115	1,350,000.00	1,513,448.14
3.75 NETH GOVT 420115	1,080,000.00	1,923,545.88
3.75 O.A.T 210425	1,200,000.00	1,255,352.40
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	150,000.00	325,756.50
3.8 SPAIN GOVT 240430	3,450,000.00	3,944,802.45
3.9 IRISH GOVT 230320	1,000,000.00	1,123,585.60
4 BEL GOVT 220328	1,500,000.00	1,635,211.50
4 BEL GOVT 320328	680,000.00	975,647.68
4 BUND 370104	2,300,000.00	3,948,872.30
4 FINNISH GOVT 250704	400,000.00	488,338.40
4 ITALY GOVT 370201	3,150,000.00	4,016,486.25
4 NETH GOVT 370115	1,420,000.00	2,355,300.04
4 O.A.T 381025	2,900,000.00	4,670,309.35
4 O.A.T 550425	900,000.00	1,758,796.20
4 O.A.T 600425	1,700,000.00	3,481,249.80
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	1,530,000.00	2,496,351.06
4.2 SPAIN GOVT 370131	3,270,000.00	4,763,068.92
4.25 BEL GOVT 210928	550,000.00	589,202.13
4.25 BEL GOVT 220928	1,800,000.00	2,012,630.40
4.25 BEL GOVT 410328	1,700,000.00	2,886,380.70
4.25 BUND 390704	1,550,000.00	2,888,231.25
4.4 SPAIN GOVT 231031	2,000,000.00	2,305,726.00
4.5 BEL GOVT 260328	980,000.00	1,246,444.36
4.5 ITALY GOVT 230501	2,600,000.00	2,903,014.40
4.5 ITALY GOVT 240301	2,900,000.00	3,304,518.10
4.5 O.A.T 410425	3,010,000.00	5,315,858.66
4.65 SPAIN GOVT 250730	1,640,000.00	2,005,501.88
4.7 SPAIN GOVT 410730	1,300,000.00	2,102,360.00
4.75 BUND 280704	2,100,000.00	3,013,842.30
4.75 BUND 340704	1,980,000.00	3,428,263.08
4.75 BUND 400704	710,000.00	1,423,628.02
4.75 ITALY GOVT 210901	4,400,000.00	4,667,610.64
4.75 ITALY GOVT 230801	3,430,000.00	3,886,876.00
4.75 ITALY GOVT 280901	1,170,000.00	1,473,038.19
4.75 ITALY GOVT 440901	2,470,000.00	3,577,512.92
4.75 O.A.T 350425	3,350,000.00	5,461,605.50
4.8 SPAIN GOVT 240131	2,400,000.00	2,822,373.60
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	800,000.00	1,034,565.60
4.9 SPAIN GOVT 400730	1,370,000.00	2,237,400.43
5 BEL GOVT 350328	1,890,000.00	3,128,670.09
5 ITALY GOVT 220301	3,650,000.00	3,964,133.60
5 ITALY GOVT 250301	4,600,000.00	5,468,743.58

	5 ITALY GOVT 340801	3,100,000.00	4,290,876.47	
	5 ITALY GOVT 390801	2,540,000.00	3,690,594.60	
	5 ITALY GOVT 400901	1,700,000.00	2,477,223.00	
	5.15 SPAIN GOVT 281031	2,800,000.00	3,820,152.00	
	5.15 SPAIN GOVT 441031	2,030,000.00	3,568,537.00	
	5.25 ITALY GOVT 291101	4,380,000.00	5,801,643.31	
	5.4 IRISH GOVT 250313	1,300,000.00	1,643,993.65	
	5.4 SPAIN GOVT 230131	4,450,000.00	5,124,490.95	
	5.5 BEL GOVT 280328	2,700,000.00	3,865,995.00	
	5.5 BUND 310104	1,890,000.00	3,101,934.15	
	5.5 ITALY GOVT 221101	5,300,000.00	5,962,250.90	
	5.5 NETH GOVT 280115	1,850,000.00	2,674,474.70	
	5.5 O.A.T 290425	5,100,000.00	7,577,911.50	
	5.625 BUND 280104	2,200,000.00	3,254,785.60	
	5.75 ITALY GOVT 330201	2,450,000.00	3,559,337.95	
	5.75 O.A.T 321025	4,370,000.00	7,300,154.92	
	5.75 SPAIN GOVT 320730	2,700,000.00	4,199,223.60	
	5.85 SPAIN GOVT 220131	2,750,000.00	3,056,586.50	
	5.9 SPAIN GOVT 260730	2,500,000.00	3,328,550.00	
	6 ITALY GOVT 310501	1,520,000.00	2,176,416.56	
	6.25 AUSTRIA GOVT 270715	950,000.00	1,378,574.45	
	6.25 BUND 240104	1,000,000.00	1,261,272.00	
	6.25 BUND 300104	1,530,000.00	2,536,750.71	
	6.5 BUND 270704	1,650,000.00	2,499,629.55	
	6.5 ITALY GOVT 271101	2,550,000.00	3,484,324.08	
	7.25 ITALY GOVT 261101	1,600,000.00	2,205,800.00	
	7.5 NETH GOVT 230115	400,000.00	491,140.40	
	8.5 O.A.T 230425	1,650,000.00	2,106,594.60	
	9 ITALY GOVT 231101	450,000.00	580,245.25	
ユーロ合計		472,040,000.00	564,721,887.96 (67,727,096,023)	
合計			190,184,290,785 (190,184,290,785)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 149銘柄	100.00%	50.76%

カナダドル	国債証券	22銘柄	100.00%	1.96%
オーストラリアドル	国債証券	18銘柄	100.00%	1.86%
イギリスポンド	国債証券	36銘柄	100.00%	6.50%
シンガポールドル	国債証券	15銘柄	100.00%	0.69%
スウェーデンクローネ	国債証券	7銘柄	100.00%	0.27%
ノルウェークローネ	国債証券	9銘柄	100.00%	0.23%
デンマーククローネ	国債証券	6銘柄	100.00%	0.55%
メキシコペソ	国債証券	14銘柄	100.00%	0.66%
ポーランドズロチ	国債証券	12銘柄	100.00%	0.52%
南アフリカランド	国債証券	13銘柄	100.00%	0.39%
ユーロ	国債証券	233銘柄	100.00%	35.61%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

２【ファンドの現況】

【三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）】

【純資産額計算書】

令和 2年 3月31日現在

（単位：円）

資産総額	8,898,682,231
負債総額	34,098,765
純資産総額（ - ）	8,864,583,466
発行済口数	7,911,833,677口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.1204
（10,000口当たり）	（11,204）

（参考）

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 3月31日現在

（単位：円）

資産総額	592,082,501,858
負債総額	7,610,485,052
純資産総額（ - ）	584,472,016,806
発行済口数	432,539,269,896口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.3513
（10,000口当たり）	（13,513）

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 3月31日現在

（単位：円）

資産総額	182,184,311,241
負債総額	1,013,186,923
純資産総額（ - ）	181,171,124,318
発行済口数	129,644,501,648口

1口当たり純資産価額（ / ）	1.3974
（10,000口当たり）	（13,974）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、委託会社は、この信託の受益権を取扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

（2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

該当事項はありません。

（4）受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（5）受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

（6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、解約請求の受付け、解約代金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額等

2020年3月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近５年間における資本金の額の増減はありません。

（２）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

業務執行の基本方針を決定し、取締役の職務の執行を監督する機関として、取締役会を設置します。取締役の選任は、総株主の議決権の３分の１以上を有する株主が出席する株主総会にてその議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。また、取締役会で決定した基本方針に基づき、経営管理全般に関する執行方針その他重要な事項を協議・決定する機関として、経営会議を設置します。

・投資運用の意思決定機構

投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

投資行動のモニタリング１

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

投資行動のモニタリング２

運用部から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に係る法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

２【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信

託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

2020年 3月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本 数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	872	12,674,222
追加型公社債投資信託	16	1,269,684
単位型株式投資信託	64	355,316
単位型公社債投資信託	14	74,863
合 計	966	14,374,084

なお、純資産総額の金額については、百万円未満の端数を四捨五入して記載しておりますので、表中の個々の数字の合計と合計欄の数字とは一致しないことがあります。

3【委託会社等の経理状況】

（１）財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱ＵＦＪ国際投信株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」（以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年内閣府令第52号）」に基づき作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和52年大蔵省令第38号）」（以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表に掲載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

（２）監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第34期事業年度（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第35期事業年度に係る中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

(単位：千円)

	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
(資産の部)		

流動資産				
現金及び預金	2	54,140,307	2	53,969,686
有価証券		19,967		1,403,513
前払費用		362,886		514,587
未収入金		2,109		2,284
未収委託者報酬		9,770,529		9,995,458
未収収益	2	674,156	2	560,483
金銭の信託	2	30,000	2	100,000
その他		224,645		153,256
流動資産合計		65,224,602		66,699,271
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	760,010	1	617,032
器具備品	1	724,852	1	665,247
土地		1,356,000		628,433
有形固定資産合計		2,840,863		1,910,713
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		2,654,296		3,670,753
ソフトウェア仮勘定		1,097,970		536,345
無形固定資産合計		3,768,090		4,222,921
投資その他の資産				
投資有価証券		26,361,327		21,408,781
関係会社株式		320,136		320,136
投資不動産		-	1	824,268
長期差入保証金		627,141		593,536
前払年金費用		434,700		415,234
繰延税金資産		1,237,989		1,496,180
その他		45,230		45,230
貸倒引当金		23,600		23,600
投資その他の資産合計		29,002,925		25,079,767
固定資産合計		35,611,879		31,213,401
資産合計		100,836,481		97,912,673

(単位：千円)

	第33期 (平成30年3月31日現在)		第34期 (平成31年3月31日現在)	
(負債の部)				
流動負債				
預り金		359,176		293,258
未払金				
未払収益分配金		174,333		170,281
未払償還金		456,159		448,695
未払手数料	2	3,905,670	2	3,990,054
その他未払金	2	4,330,584	2	3,961,765
未払費用	2	4,388,803	2	3,803,995
未払消費税等		99,010		194,852
未払法人税等		736,829		573,657
賞与引当金		906,167		901,135

役員賞与引当金	125,343	140,100
その他	842,194	868,992
流動負債合計	16,324,272	15,346,788
固定負債		
長期未払金	-	43,200
退職給付引当金	720,536	860,851
役員退職慰労引当金	187,562	144,303
時効後支払損引当金	254,851	247,767
固定負債合計	1,162,951	1,296,122
負債合計	17,487,223	16,642,910
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金	3,572,096	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712	44,732,712
利益剰余金		
利益準備金	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金	27,790,911	26,069,594
利益剰余金合計	35,131,500	33,410,184
株主資本合計	81,864,344	80,143,028

(単位：千円)

	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,484,913	1,126,733
評価・換算差額等合計	1,484,913	1,126,733
純資産合計	83,349,257	81,269,762
負債純資産合計	100,836,481	97,912,673

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	75,423,596	70,375,414
投資顧問料	2,723,458	2,505,299
その他営業収益	48,215	18,844
営業収益合計	78,195,269	72,899,557
営業費用		
支払手数料	2 30,906,879	2 28,533,952
広告宣伝費	730,784	739,643

公告費	1,000	500
調査費		
調査費	1,723,057	1,794,755
委託調査費	13,467,029	12,194,996
事務委託費	864,916	1,016,816
営業雑経費		
通信費	178,652	170,794
印刷費	467,973	427,442
協会費	50,251	48,375
諸会費	15,328	16,175
事務機器関連費	1,635,079	1,841,631
その他営業雑経費	23,250	-
営業費用合計	50,064,204	46,785,083
一般管理費		
給料		
役員報酬	349,359	349,083
給料・手当	6,421,837	6,453,717
賞与引当金繰入	906,167	901,135
役員賞与引当金繰入	125,343	140,100
福利厚生費	1,231,033	1,234,293
交際費	13,012	13,011
旅費交通費	192,192	200,426
租税公課	410,229	373,201
不動産賃借料	678,182	654,886
退職給付費用	423,171	428,912
役員退職慰労引当金繰入	47,889	51,159
固定資産減価償却費	1,115,719	1,252,321
諸経費	450,299	523,213
一般管理費合計	12,364,437	12,575,461
営業利益	15,766,627	13,539,012

(単位：千円)

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	349,402	181,073
受取利息	2 483	2 1,913
投資有価証券償還益	81,580	416,706
収益分配金等時効完成分	91,672	44,392
受取賃貸料	-	2 38,388
その他	9,989	11,871
営業外収益合計	533,128	694,346
営業外費用		
投資有価証券償還損	30,114	118,173
時効後支払損引当金繰入	43,182	1,166
事務過誤費	10,402	420
賃貸関連費用	-	35,994
その他	3,829	1,481
営業外費用合計	87,529	157,235

経常利益		16,212,226		14,076,123
特別利益				
投資有価証券売却益		516,394		501,778
ゴルフ会員権売却益		7,495		-
特別利益合計		523,889		501,778
特別損失				
投資有価証券売却損		105,903		135,399
投資有価証券評価損		102,096		62,310
固定資産除却損	1	54	1	4,848
固定資産売却損		-		225
システム関連費		-		322,986
商標使用料		-		90,000
特別損失合計		208,054		615,770
税引前当期純利益		16,528,061		13,962,130
法人税、住民税及び事業税	2	5,252,224	2	4,420,179
法人税等調整額		76,092		100,112
法人税等合計		5,176,132		4,320,066
当期純利益		11,351,928		9,642,064

（３）【株主資本等変動計算書】

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	43,034,713	50,375,303	97,108,147
当期変動額									
剰余金の配当							26,595,731	26,595,731	26,595,731
当期純利益							11,351,928	11,351,928	11,351,928
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	—	—	—	—	—	—	15,243,802	15,243,802	15,243,802
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	27,790,911	35,131,500	81,864,344

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,494,586	1,494,586	98,602,734
当期変動額			
剰余金の配当			26,595,731
当期純利益			11,351,928
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	9,673	9,673	9,673
当期変動額合計	9,673	9,673	15,253,476
当期末残高	1,484,913	1,484,913	83,349,257

第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本剰余金			利益剰余金		
					その他利益剰余金	

	資本金	資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計	利益 準備金	別途 積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	株主資本合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	27,790,911	35,131,500	81,864,344
当期変動額									
剰余金の配当							11,363,380	11,363,380	11,363,380
当期純利益							9,642,064	9,642,064	9,642,064
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)									
当期変動額合計	—	—	—	—	—	—	1,721,316	1,721,316	1,721,316
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,069,594	33,410,184	80,143,028

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,484,913	1,484,913	83,349,257
当期変動額			
剰余金の配当			11,363,380
当期純利益			9,642,064
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	358,179	358,179	358,179
当期変動額合計	358,179	358,179	2,079,495
当期末残高	1,126,733	1,126,733	81,269,762

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	5年～50年
器具備品	2年～20年
投資不動産	3年～47年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。

3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3)役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4)退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理することとしております。

数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（主として10年）による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。

(5)役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

(6)時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1)消費税等の会計処理

税抜方式を採用しており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

(2)連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（表示方法の変更）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示する方法に変更しております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」490,903千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,237,989千円に含めて表示しております。

（未適用の会計基準等）

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日 企業会計基準委員会）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日 企業会計基準委員会）

(1)概要

国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、平成26年5月に「顧客との契約から生じる収益」（IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic606）を公表しており、IFRS第15号は平成30年1月1日以後開始する事業年度から、Topic606は平成29年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわせない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

(2)適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

(3)当該会計基準等の適用による影響

「収益認識に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価

中であります。

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
建物	604,123千円	551,025千円
器具備品	1,215,234千円	1,350,407千円
投資不動産	—	138,024千円

2. 関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
預金	41,809,118千円	240,211千円
未収収益	40,621千円	25,307千円
金銭の信託	30,000千円	100,000千円
未払手数料	1,577,059千円	671,568千円
その他未払金	3,850,734千円	3,217,341千円
未払費用	430,491千円	444,754千円

（損益計算書関係）

1. 固定資産除却損の内訳

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
建物	—	2,547千円
器具備品	54千円	2,301千円
計	54千円	4,848千円

2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
支払手数料	11,380,244千円	5,298,064千円
受取利息	380千円	3千円
受取賃貸料	—	38,388千円
法人税、住民税及び事業税	3,851,536千円	3,216,517千円

（株主資本等変動計算書関係）

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成29年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	26,595,731千円
1株当たり配当額	125,700円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月29日

- (2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
平成30年6月27日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	11,363,380千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	53,707円
基準日	平成30年3月31日
効力発生日	平成30年6月28日

第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1)配当金支払額

平成30年6月27日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	11,363,380千円
1株当たり配当額	53,707円
基準日	平成30年3月31日
効力発生日	平成30年6月28日

- (2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
令和元年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	9,675,175千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	45,728円
基準日	平成31年3月31日
効力発生日	令和 元年6月27日

（リース取引関係）

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
1年内	678,116千円	675,956千円
1年超	1,351,912千円	675,956千円
合計	2,030,029千円	1,351,912千円

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、譲渡性預金または投資信託に限定しており、金融機関からの資金調達は行っておりません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2.金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

第33期(平成30年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 現金及び預金	54,140,307	54,140,307	-
(2) 有価証券	19,967	19,967	-
(3) 未収委託者報酬	9,770,529	9,770,529	-
(4) 投資有価証券	26,224,167	26,224,167	-
資産計	90,154,972	90,154,972	-
(1) 未払手数料	3,905,670	3,905,670	-
負債計	3,905,670	3,905,670	-

第34期(平成31年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 現金及び預金	53,969,686	53,969,686	-
(2) 有価証券	1,403,513	1,403,513	-
(3) 未収委託者報酬	9,995,458	9,995,458	-
(4) 投資有価証券	21,353,421	21,353,421	-
資産計	86,722,080	86,722,080	-
(1) 未払手数料	3,990,054	3,990,054	-
負債計	3,990,054	3,990,054	-

(注1)金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資 産

(1)現金及び預金、(3)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2)有価証券、(4)投資有価証券

これらはすべて投資信託であり、時価は基準価額によっております。

負 債

(1)未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
非上場株式	137,160	55,360
子会社株式	160,600	160,600
関連会社株式	159,536	159,536

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3)金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第33期(平成30年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	54,140,307	-	-	-
未収委託者報酬	9,770,529	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	19,967	13,110,758	8,593,680	68,714
合計	63,930,804	13,110,758	8,593,680	68,714

第34期(平成31年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	53,969,686	-	-	-
未収委託者報酬	9,995,458	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	1,403,513	9,358,708	5,874,634	90,573
合計	65,368,659	9,358,708	5,874,634	90,573

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円、前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

2. その他有価証券

第33期(平成30年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	18,599,111	16,040,884	2,558,227
	小計	18,599,111	16,040,884	2,558,227
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	7,645,023	8,062,990	417,966
	小計	7,645,023	8,062,990	417,966
合計		26,244,135	24,103,874	2,140,260

第34期(平成31年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	14,744,545	12,559,380	2,185,164
	小計	14,744,545	12,559,380	2,185,164
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	8,012,389	8,573,551	561,161
	小計	8,012,389	8,573,551	561,161
合計		22,756,935	21,132,932	1,624,002

3.売却したその他有価証券

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他	8,169,769	516,394	105,903
合計	8,169,769	516,394	105,903

第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
株式	140,240	58,440	-
債券	-	-	-
その他	5,222,594	443,338	135,399
合計	5,362,834	501,778	135,399

4.減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について102,096千円（その他有価証券のその他102,096千円）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について62,310千円（その他有価証券のその他62,310千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

（退職給付関係）

1.採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度（積立型制度）及び退職一時金制度（非積立型制度）を設けております。また確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

2.確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,649,089 千円	3,729,252 千円
勤務費用	184,120	193,531
利息費用	27,829	24,351
数理計算上の差異の発生額	56,895	15,898
退職給付の支払額	188,683	218,947
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	3,729,252	3,712,289

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
年金資産の期首残高	2,698,738 千円	2,723,393 千円
期待運用収益	48,080	48,664
数理計算上の差異の発生額	47,759	4,606
事業主からの拠出額	102,564	102,564
退職給付の支払額	173,748	203,077
年金資産の期末残高	2,723,393	2,666,937

(3)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	3,374,562 千円	3,125,760 千円
年金資産	2,723,393	2,666,937
非積立型制度の退職給付債務	651,168	458,822
未積立退職給付債務	354,690	586,529
未積立退職給付債務	1,005,858	1,045,351
未認識数理計算上の差異	169,893	114,968
未認識過去勤務費用	550,128	484,766
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	285,836	445,616
退職給付引当金	720,536	860,851
前払年金費用	434,700	415,234
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	285,836	445,616

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
勤務費用	184,120 千円	193,531 千円
利息費用	27,829	24,351
期待運用収益	48,080	48,664
数理計算上の差異の費用処理額	47,053	43,633
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	4,780	5,986
確定給付制度に係る退職給付費用	281,066	284,199

（注）「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額等です。

(5)年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
債券	62.2 %	63.9 %
株式	34.7	33.2
その他	3.1	2.9
合計	100	100

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
割引率	0.069～0.67%	0.035～0.49%
長期期待運用収益率	1.5～1.8%	1.5～1.8%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度142,105千円、当事業年度144,712千円であります。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	445,379千円	436,050千円
投資有価証券評価損	223,512	223,821
未払事業税	135,805	109,109
賞与引当金	277,468	275,927
役員賞与引当金	12,235	19,428
役員退職慰労引当金	57,431	44,185
退職給付引当金	220,628	263,592
減価償却超過額	13,690	157,741
委託者報酬	257,879	264,398
長期差入保証金	23,262	31,721
時効後支払損引当金	78,035	75,866
連結納税適用による時価評価	200,331	148,858
その他	82,168	71,320
繰延税金資産 小計	2,027,829	2,122,023
評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	2,027,829	2,122,023
繰延税金負債		
前払年金費用	133,105	127,144
連結納税適用による時価評価	1,382	1,320
その他有価証券評価差額金	655,348	497,269
その他	4	108
繰延税金負債 合計	789,840	625,842
繰延税金資産の純額	1,237,989	1,496,180

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

第33期（平成30年3月31日現在）及び第34期（平成31年3月31日現在）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）及び第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）及び第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2.地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3.主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (注4)	科目	期末残高 (注4)
親会社	㈱三菱UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税	連結納税に 伴う支払 (注1)	3,851,587 千円	その他未払金	3,850,734 千円
親会社	三菱UFJ 信託銀行㈱	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 51.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,528,131 千円	未払手数料	665,262 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 (注3)	664,152 千円	未払費用	348,142 千円
主要株主	㈱三菱東京 UFJ銀行 (注5)	東京都 千代田 区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,852,112 千円	未払手数料	921,796 千円

第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (注4)	科目	期末残高 (注4)
親会社	㈱三菱UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税	連結納税に 伴う支払 (注1)	3,216,517 千円	その他未払金	3,217,341 千円

親会社	三菱UFJ 信託銀行(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,298,064 千円	未払手数料	671,568 千円
						投資の助言	投資助言料 (注3)	695,834 千円	未払費用	365,510 千円
						役員の兼任				

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 1. 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

2. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

3. 投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。

4. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

5. (株)三菱東京UFJ銀行は、平成30年4月1日付で、(株)三菱UFJ銀行に行名を変更しております。

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

種類	会社等の 名称	所在地	資本金	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (注4)	科目	期末残高 (注4)
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・ スタンレー 証券(株)	東京都 千代田 区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	6,263,571 千円	未払手数料	907,290 千円

第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

種類	会社等の 名称	所在地	資本金	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (注4)	科目	期末残高(注 4)
同一の親会社を持つ会社	(株)三菱UFJ 銀行	東京都 千代田 区	1,711,958 百万円	銀行業	なし (注1)	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	4,629,670 千円	未払手数料	734,633 千円
						取引銀行	コーラブル預 金の預入 (注3)	20,000,000 千円	現金及び 預金	20,000,000 千円
							コーラブル預 金に係る受取 利息 (注3)	1,578 千円	未収収益	1,578 千円

同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・ スタンレー 証券㈱	東京都 千代田 区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	6,152,016 千円	未払手数料	962,840 千円
-------------	--------------------------------	-----------------	---------------	-----	----	---	---------------------------------------	-----------------	-------	---------------

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 1. ㈱三菱UFJ銀行は、平成30年4月2日付で、保有する当社株式のすべてを㈱三菱UFJフィナンシャル・グループに対して現物配当しております。その結果、㈱三菱UFJ銀行は当社の主要株主から同一の親会社を持つ会社に該当することとなりました。

なお、㈱三菱UFJフィナンシャル・グループは、同日付で、取得した当社株式のすべてを会社分割の方法により三菱UFJ信託銀行㈱に対して承継させております。

- 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。
- 預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は1年であります。
- 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
1株当たり純資産額	393,935.45円	384,107.08円
1株当たり当期純利益金額	53,652.87円	45,571.50円

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
当期純利益金額（千円）	11,351,928	9,642,064
普通株主に帰属しない金額（千円）	-	-
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	11,351,928	9,642,064
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581	211,581

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第35期中間会計期間
(令和元年9月30日現在)

(資産の部)

流動資産

現金及び預金

46,350,665

有価証券		3,906,355
前払費用		620,446
未収入金		8,561
未収委託者報酬		10,170,592
未収収益		585,312
金銭の信託		100,000
その他		134,705
流動資産合計		61,876,640
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	603,277
器具備品	1	794,065
土地		628,433
有形固定資産合計		2,025,776
無形固定資産		
電話加入権		15,822
ソフトウェア		3,390,287
ソフトウェア仮勘定		1,024,221
無形固定資産合計		4,430,330
投資その他の資産		
投資有価証券		18,792,024
関係会社株式		320,136
投資不動産	1	822,988
長期差入保証金		579,291
前払年金費用		420,773
繰延税金資産		1,420,372
その他		45,230
貸倒引当金		23,600
投資その他の資産合計		22,377,216
固定資産合計		28,833,324
資産合計		90,709,964

(単位：千円)

第35期中間会計期間
(令和元年9月30日現在)

(負債の部)

流動負債		
預り金		290,587
未払金		
未払収益分配金		131,632
未払償還金		424,093
未払手数料		4,009,808
その他未払金		2,100,383
未払費用		3,020,441
未払消費税等	2	381,045
未払法人税等		651,051
賞与引当金		924,061
役員賞与引当金		62,295
その他		900,753
流動負債合計		12,896,152

固定負債

長期未払金		32,400
退職給付引当金		940,446
役員退職慰労引当金		107,709

時効後支払損引当金	243,873
固定負債合計	1,324,430
負債合計	14,220,582
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,131
資本剰余金	
資本準備金	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712
利益剰余金	
利益準備金	342,589
その他利益剰余金	
別途積立金	6,998,000
繰越利益剰余金	21,264,872
利益剰余金合計	28,605,462
株主資本合計	75,338,306

(単位：千円)

第35期中間会計期間
(令和元年9月30日現在)

評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,151,075
評価・換算差額等合計	1,151,075
純資産合計	76,489,381
負債純資産合計	90,709,964

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第35期中間会計期間
(自 平成31年4月1日
至 令和元年9月30日)

営業収益	
委託者報酬	34,073,281
投資顧問料	1,143,410
その他営業収益	8,361
営業収益合計	35,225,053
営業費用	
支払手数料	13,714,724
広告宣伝費	252,678
公告費	250
調査費	
調査費	911,961
委託調査費	5,769,907
事務委託費	351,511
営業雑経費	
通信費	78,084
印刷費	218,610
協会費	25,207
諸会費	8,034
事務機器関連費	931,984
営業費用合計	22,262,956
一般管理費	
給料	

役員報酬		177,096
給料・手当		2,873,051
賞与引当金繰入		924,061
役員賞与引当金繰入		62,295
福利厚生費		635,789
交際費		4,597
旅費交通費		97,388
租税公課		193,484
不動産賃借料		327,917
退職給付費用		212,710
役員退職慰労引当金繰入		25,108
固定資産減価償却費	1	647,817
諸経費		177,080
一般管理費合計		6,358,399
営業利益		6,603,697

(単位：千円)

第35期中間会計期間 (自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日)		
営業外収益		
受取配当金		34,517
受取利息		2,101
投資有価証券償還益		327,868
収益分配金等時効完成分		73,834
受取賃貸料		32,904
その他		15,364
営業外収益合計		486,590
営業外費用		
投資有価証券償還損		46,457
賃貸関連費用	1	12,337
その他		175
営業外費用合計		58,970
経常利益		7,031,318
特別利益		
投資有価証券売却益		53,850
特別利益合計		53,850
特別損失		
投資有価証券売却損		36,721
投資有価証券評価損		17,395
固定資産除却損		37
固定資産売却損		435
特別損失合計		54,589
税引前中間純利益		7,030,579
法人税、住民税及び事業税		2,095,061
法人税等調整額		65,064
法人税等合計		2,160,126
中間純利益		4,870,453

(3)中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日）

(単位：千円)

	株主資本
--	------

	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,069,594	33,410,184	80,143,028
当中間期変動額									
剰余金の配当							9,675,175	9,675,175	9,675,175
中間純利益							4,870,453	4,870,453	4,870,453
株主資本以外の 項目の当中 間 期 変 動 額 (純額)									
当中間期変動額合 計	—	—	—	—	—	—	4,804,722	4,804,722	4,804,722
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	21,264,872	28,605,462	75,338,306

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,126,733	1,126,733	81,269,762
当中間期変動額			
剰余金の配当			9,675,175
中間純利益			4,870,453
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	24,341	24,341	24,341
当中間期変動額合計	24,341	24,341	4,780,380
当中間期末残高	1,151,075	1,151,075	76,489,381

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

中間決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 5年～50年

器具備品 2年～20年

投資不動産 3年～47年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

す。

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理することとしております。

数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（主として10年）による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。

(5) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく中間期末要支給額を計上しております。

(6) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

[注記事項]

（中間貸借対照表関係）

1 減価償却累計額

	第35期中間会計期間 (令和元年9月30日現在)
建物	575,110千円
器具備品	1,377,937千円
投資不動産	141,659千円

2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

（中間損益計算書関係）

1 減価償却実施額

	第35期中間会計期間 (自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日)
有形固定資産	85,187千円
無形固定資産	562,630千円
投資不動産	3,634千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第35期中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当中間会計期間 増加株式数（株）	当中間会計期間 減少株式数（株）	当中間会計期間末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	211,581	-	-	211,581
合計	211,581	-	-	211,581

2. 配当に関する事項

令和元年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	9,675,175千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	45,728円
基準日	平成31年3月31日
効力発生日	令和元年6月27日

（リース取引関係）

第35期中間会計期間（令和元年9月30日現在）

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

1年内	675,956千円
1年超	337,978千円
合 計	1,013,934千円

（金融商品関係）

第35期中間会計期間（令和元年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

令和元年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

	中間貸借対照表計 上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 現金及び預金	46,350,665	46,350,665	-
(2) 有価証券	3,906,355	3,906,355	-
(3) 未収委託者報酬	10,170,592	10,170,592	-
(4) 投資有価証券	18,736,664	18,736,664	-
資産計	79,164,277	79,164,277	-
(1) 未払手数料	4,009,808	4,009,808	-
負債計	4,009,808	4,009,808	-

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資 産

(1)現金及び預金、(3)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2)有価証券、(4)投資有価証券

これらはすべて投資信託であり、時価は基準価額によっております。

負 債

(1)未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額に

っております。

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（中間貸借対照表計上額55,360千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（注３）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

（有価証券関係）

第35期中間会計期間（令和元年9月30日現在）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	16,466,321	14,354,198	2,112,123
	小 計	16,466,321	14,354,198	2,112,123
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	6,176,697	6,629,733	453,035
	小 計	6,176,697	6,629,733	453,035
合 計		22,643,019	20,983,931	1,659,087

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額55,360千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難であると認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 減損処理を行った有価証券

当中間会計期間において、有価証券について17,395千円（その他有価証券のその他17,395千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、中間期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第35期中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第35期中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

（１）営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(1 株当たり情報)

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期中間会計期間 (令和元年9月30日現在)
1株当たり純資産額	361,513.47円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	76,489,381
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	76,489,381
1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株)	211,581

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期中間会計期間 (自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日)
1株当たり中間純利益金額	23,019.33円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	4,870,453
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	4,870,453
普通株式の期中平均株式数(株)	211,581

(注)潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称：三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（2019年9月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (2019年9月末現在)	事業の内容
株式会社三菱ＵＦＪ銀行	1,711,958 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社北國銀行	26,673 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社滋賀銀行	33,076 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社南都銀行	37,924 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社紀陽銀行	80,096 百万円	銀行業務を営んでいます。
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社みずほ銀行	1,404,065 百万円	銀行業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社：ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

(2) 販売会社：ファンドの募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。

3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2020年3月末現在）

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%（211,581株）を所有しています。

（注）関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

第3【その他】

(1) 目論見書の表紙にロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、また使用開始日、ファンドの形態、申込みに係る事項、ファンド専用サイトのアドレスなどを記載することがあります。

(2) 投資信託説明書（交付目論見書）に、以下の趣旨の文言の全部または一部および有価証券届出

書の主要内容を記載することがあります。

- ・ファンドに関する投資信託説明書（請求目論見書）を含む詳細な情報は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
- ・本書には、約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されていません。
- ・ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- ・ファンドの商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認します。
- ・ファンドの財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
- ・請求目論見書は、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。（請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようお願いいたします。）
- ・有価証券届出書の効力の発生の有無については、委託会社のホームページにて確認いただけます。効力が発生するまでに、本書の記載内容が訂正される場合があります。

（３）投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。

（４）目論見書は電磁的方法により提供されるほか、インターネット、電子媒体等に掲載されることがあります。

（５）投信評価機関、投信評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。

（６）目論見書は「投資信託説明書」を別称として使用します。

（７）目論見書に委託会社のホームページアドレス等を掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨のご案内を記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

令和元年6月26日

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

取締役会 御 中

有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

青 木 裕 晃 印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊 藤 鉄 也 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱ＵＦＪ国際投信株式会社の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第34期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱ＵＦＪ国際投信株式会社の平成31年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。

独立監査人の監査報告書

令和２年４月30日

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 和田 渉 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）の平成31年３月26日から令和２年３月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）の令和２年３月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

令和元年12月3日

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

青木 裕晃 印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊藤 鉄也 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱ＵＦＪ国際投信株式会社の平成31年4月1日から令和2年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間（平成31年4月1日から令和元年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱ＵＦＪ国際投信株式会社の令和元年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成31年4月1日から令和元年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは中間監査の対象に含まれていません。