【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年4月30日提出
【計算期間】	第4期(自 2020年2月6日至 2021年2月5日)
【ファンド名】	国内債券セレクション（ラップ向け）
【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 横川　直
【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
【連絡場所】	東京都千代田区有楽町一丁目１２番１号
【電話番号】	03-6250-4740
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【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、主として利子収益の確保および値上がり益の獲得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
		債券		
	海外	不動産投信	ＭＲＦ	
追加型		その他資産（　　）		特殊型（　　）
	内外		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（フルヘッジ）	日経２２５	ブル・ベア型
一般	年２回	日本				
大型株	年４回	北米			ＴＯＰＩＸ	条件付運用型
中小型株	年６回	欧州	ファンド・オブ・ファンズ	なし		
債券	（隔月）	アジア			その他（　　）	ロング・ショート型／絶対収益追求型
一般	年12回	オセアニア				
公債	（毎月）	中南米				
社債	日々	アフリカ				その他（　　）
その他債券	その他（　）	中近東（中東）				
クレジット属性（　　）		エマージング				
不動産投信						
その他資産（投資信託証券（債券 一般））						
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（ＢＢＢ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

日本を含む世界の債券を実質的な主要投資対象とし、主として利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。

ファンドの特色

特色1 投資信託証券への投資を通じて、主として日本を含む世界の債券に実質的な投資を行います。

● 投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。なお、2021年5月1日現在、投資対象となっている投資信託証券は以下の通りです。

<日本債券インデックスマザーファンド>

日本の公社債への投資を行います。

・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。
・NOMURA－BPI総合をベンチマークとします。
・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。

<先進国高格付国債マザーファンド>

日本を含む先進国の国債等への投資を行います。

・投資する国債等（日本国債を除きます。）は、原則として取得時において最上位格付けを取得しているものに限ります。
・債券等（為替ヘッジのために行う外国為替予約取引等を含みます。）の運用にあたっては、三菱UFJアセット・マネジメント(UK)に運用の指図に関する権限を委託します。
・三菱UFJアセット・マネジメント(UK)は、英国ロンドンに籍を置く三菱UFJフィナンシャル・グループの欧州における運用拠点です。国内・海外の年金基金・機関投資家中心の資産運用サービスを展開しています。

運用の指図に関する権限の委託を受ける者、委託の内容、委託の有無等については、変更する場合があります。

<MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド>

世界主要国（日本を除く）の公社債への投資を行います。

・FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）をベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。

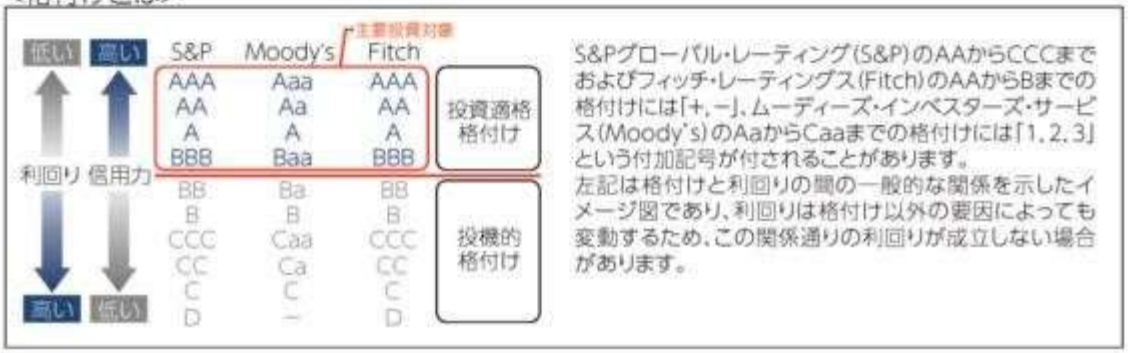
<ショートデュレーション円インカムマザーファンド>

日本を含む先進国の債券等への投資を行います。

・組入債券等は、原則として取得時においてBBB－格相当以上の格付けを有しているものに限ります。
・組入債券等の平均格付けは、原則としてA－格以上とします。
・ポートフォリオのデュレーションは、原則として0～3年程度とします。
・デュレーション調整等のため、先物取引等を利用する場合があります。

デュレーションとは、債券の投資元本の回収に要する平均残存期間や金利感応度を意味する指標です。この値が大きいほど、金利変動に対する債券価格の変動率が大きくなります。

<格付けとは>



S&Pグローバル・レーティング(S&P)のAAからCCCまでおよびフィッチ・レーティングス(Fitch)のAAからBまでの格付けには「+、－」、ムーディーズ・インベスターズ・サービス(Moody's)のAaからCaaまでの格付けには「1、2、3」という付加記号が付されることがあります。
左記は格付けと利回りの間の一般的な関係を示したイメージ図であり、利回りは格付け以外の要因によっても変動するため、この関係通りの利回りが成立しない場合があります。

<三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド>

日本の公社債を主要投資対象とします。

・日本の公社債を主要投資対象とします。ただし、事業債、円建外債についてはBBB格(S&P、ムーディーズ、格付投資情報センターおよび日本格付研究所のいずれかから取得したもの)相当以上の格付を有する債券を対象とします。
・NOMURA−BPI総合をベンチマークとし、これを中長期的に上回ることを目標に運用を行います。

<フランス国債7-10年ラダーマザーファンド>

フランスの国債を主要投資対象とします。

・主としてフランスの国債に投資を行います。原則として、残存期間が7年程度から10年程度までのフランス国債に投資し、各残存期間ごとの投資金額が同額程度になるような運用をめざします。
・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為替変動リスクの低減をはかります。

<ヘッジ付スペイン国債7-10年ラダーマザーファンド>

スペインの国債を主要投資対象とします。

・主としてスペインの国債に投資を行います。原則として、残存期間が7年程度から10年程度までのスペイン国債に投資し、各残存期間ごとの投資金額が同額程度になるような運用をめざします。
・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為替変動リスクの低減をはかります。

<日本超長期国債インデックスマザーファンド>

日本の国債を主要投資対象とします。

・NOMURA−BPI国債 超長期(11-)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
・NOMURA−BPI国債 超長期(11-)をベンチマークとします。
・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債券の実質投資比率が100%を超える場合があります。

<AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>(FOFs用)(適格機関投資家限定)>

AMP グローバル・インフラ債券マザーファンドへの投資を通じて、主として世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券等への投資を行います。

・インフラ関連企業とは、公益、通信、エネルギーおよび運輸等の日常生活に必要不可欠なサービスを提供する企業をいい、当該企業が発行する米ドル建て債券等をインフラ債券といいます。
・AMP グローバル・インフラ債券マザーファンドにおける債券等の運用にあたっては、AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドに運用の指図に関する権限を委託します。

! 運用の指図に関する権限の委託を受ける者、委託の内容、委託の有無等については、変更する場合があります。

AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッド

AMP CAPITAL

- オーストラリアを代表する総合金融グループであるAMPグループの一員で、オーストラリア大手の運用会社です。
- オーストラリアにおいて20名を超える債券運用チームを有し、特にクレジット運用に強みを持ちます。

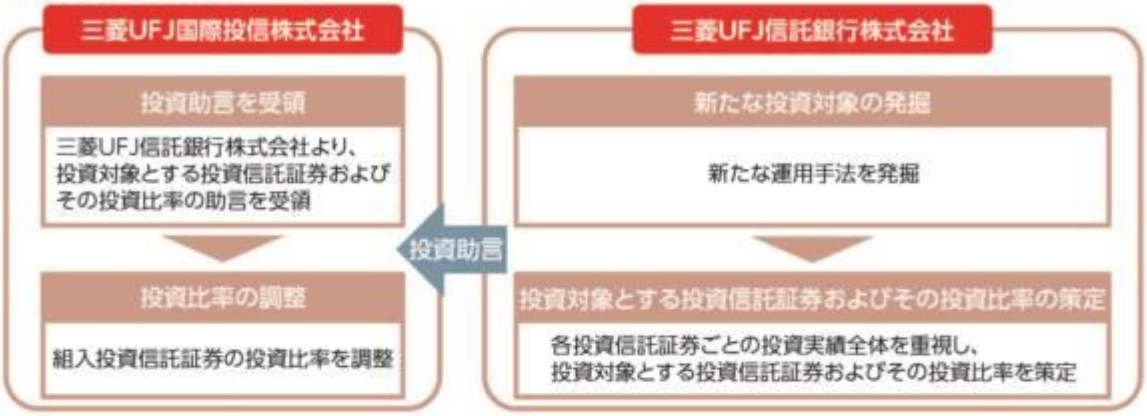
📖 ベンチマークとは、ファンドの運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指標です。

特色2 三菱UFJ信託銀行からの投資助言に基づき運用を行います。

● 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。

- 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、投資環境の変化等に応じて適宜変更します。
- 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。

<運用プロセスのイメージ>



- 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ができない場合があります。
- 「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.mufg.jp/corp/operation/fm.html)でご覧いただけます。

特色3 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。ただし、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。

為替ヘッジの活用

為替予約取引を活用し為替ヘッジを行うことにより、為替ヘッジをしなかった場合と比較して安定した値動きが期待されます。ただし、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。なお、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。

- 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。

<投資リターンのイメージ図>

- 上記は為替ヘッジを理解して頂くためのイメージ図であり、ファンドの将来の運用状況・成果等を示唆・保証するものではありません。

特色4　年1回の決算時(2月5日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。

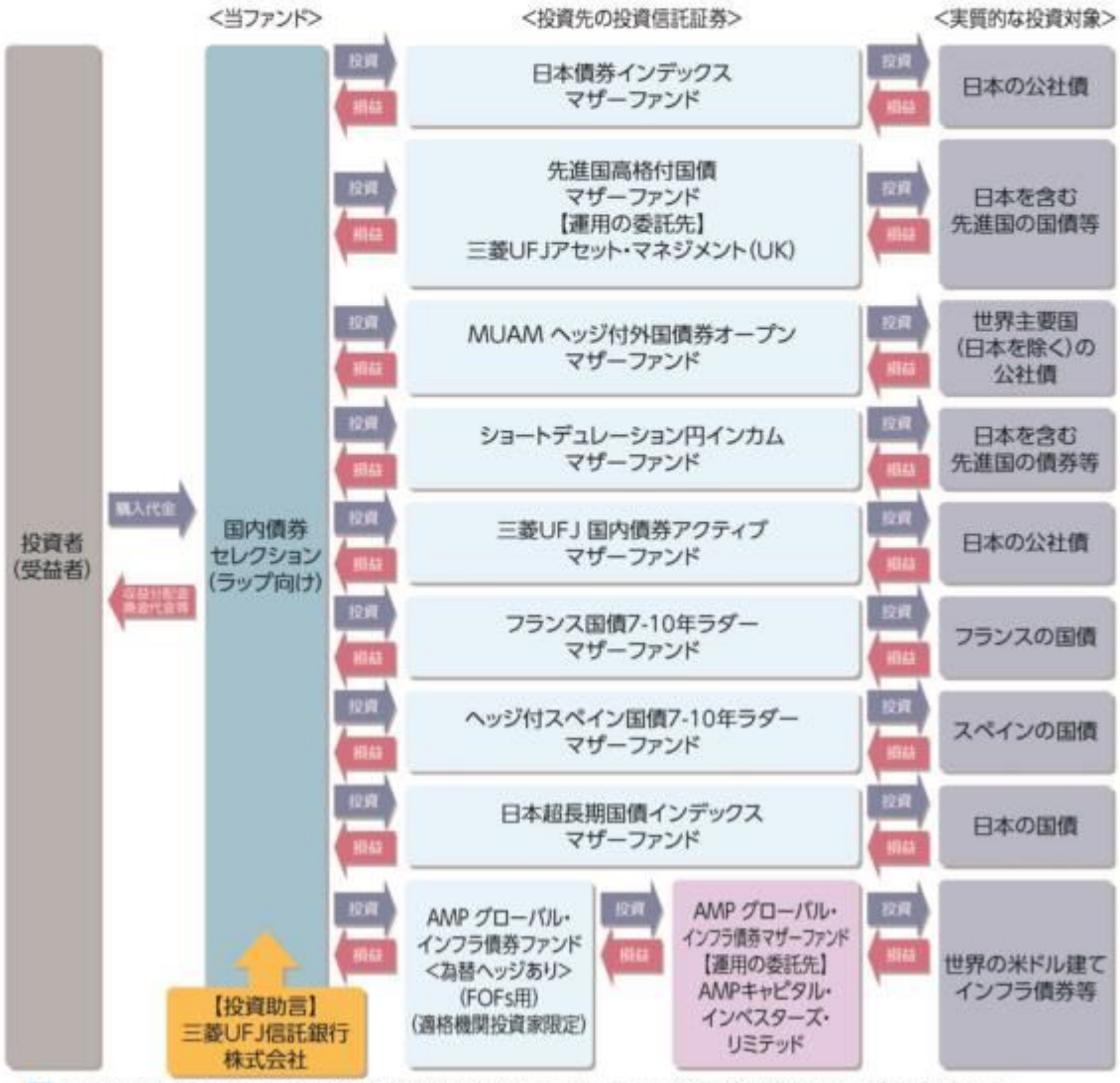
● 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

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。

■ファンドの仕組み

ファンド・オブ・ファンズ方式により運用を行います。



- 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。
- 上記の投資対象とする投資信託証券は、今後変更される場合があります。

■主な投資制限

株式	株式への直接投資は行いません。
投資信託証券	投資信託証券への投資割合に制限を設けません。
外貨建資産	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

■各投資信託証券の運用プロセス

<日本債券インデックスマザーファンド／日本超長期国債インデックスマザーファンド>

ステップ1：投資対象ユニバースの作成

ベンチマーク採用銘柄を主要投資対象とします。

ステップ2：ポートフォリオ案の作成

モニタリング結果に加えて、ファンドの資金動向やベンチマーク構成の変動などを考慮してポートフォリオ案を作成します。

ステップ3：売買執行

売買執行の際には、売買コストの抑制に留意します。

ステップ4：モニタリング

一連の投資行動を分析し、その結果をポートフォリオに反映することで、運用の継続的な改善に努めます。

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ができない場合があります。

<先進国高格付国債マザーファンド>

● 銘柄選定にあたっては、最終利回り、イールドカーブおよび為替ヘッジコスト等を勘案して決定します。

イールドカーブとは、同種類の債券の償還までの残存期間を横軸にとり、それに対応した利回りを縦軸にとった時に描かれる利回り曲線のことです。

投資対象ユニバース

FTSE世界国債インデックス構成国において
最上位格付けを取得している国および日本の国債のうち、残存期間が10年未満の国債(※)
(※)ユーロ圏の国債については、ドイツ国債を対象としています。ただし、将来変更されることがあります。

国別・残存期間別に魅力度を算出

国別・残存期間別にグルーピングし、
①最終利回り
②為替ヘッジによるプレミアム・コストの水準
③イールドカーブの形状に変化が無いとした場合の一定期間の所有期間利回り等をもとに、各グループの魅力度を算出

ポートフォリオ構築

魅力度の高いグループの国債を組み入れ、ポートフォリオを構築
*日本国債以外の国債への投資については、為替ヘッジを行います。

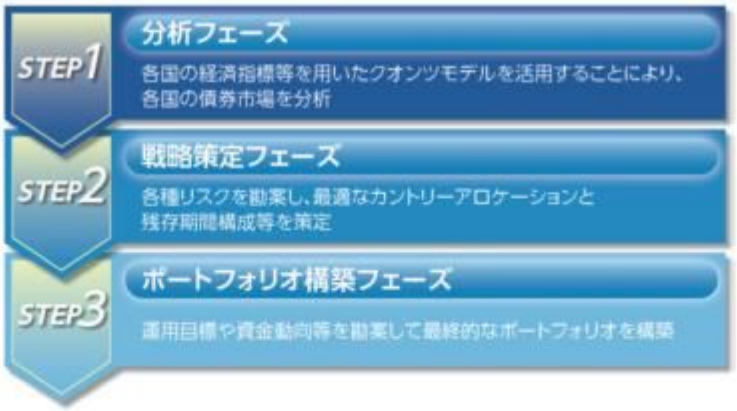
上記は銘柄選定の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

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ができない場合があります。

<MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド>

● FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)をベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。

・運用にあたっては、クオンツモデルを活用します。



! 上図はポートフォリオ構築プロセスのイメージであり、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

! 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ができない場合があります。

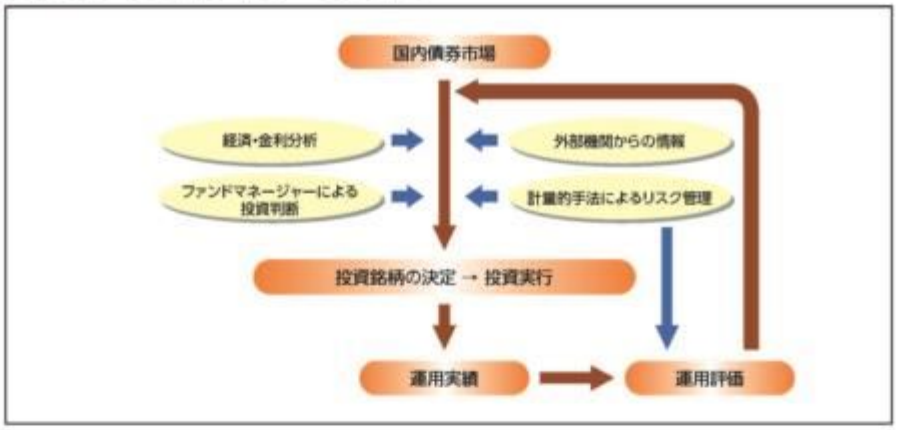
<ショートデュレーション円インカムマザーファンド>

1.リサーチ マクロ分析 金利市場分析 クレジット市場分析	地域別の景気や金融政策の詳細な分析を踏まえ、グローバル景気や金融市場の今後の動向を予測
2.各アセットクラスに対する投資比率の決定 主要投資対象 国債、政府機関債等、社債、証券化商品（モーゲージ証券等）	各アセットクラスの相対的な強弱感を踏まえ、各資産に対する投資比率を決定
3.通貨配分とデュレーションの決定	相対的な利回り水準、イールドカーブの形状、金利見通しなどを踏まえ、通貨別配分とデュレーション等を決定
4.個別銘柄の選択	投資対象資産ごとに個別銘柄を選定
5.ポートフォリオの構築	国債先物等を活用し機動的にリスクをコントロール
6.リスク管理	リスク量の計測 パフォーマンス要因分析等

📖 イールドカーブとは、同種類の債券の償還までの残存期間を横軸にとり、それに対応した利回りを縦軸にとった時に描かれる利回り曲線のことです。

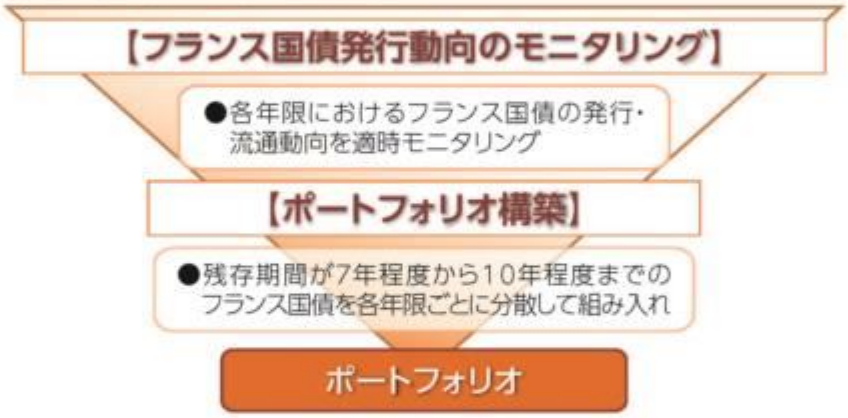
! 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、すべてを網羅するものではありません。また、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。上記のプロセスは、今後変更されることがあります。

<三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド>



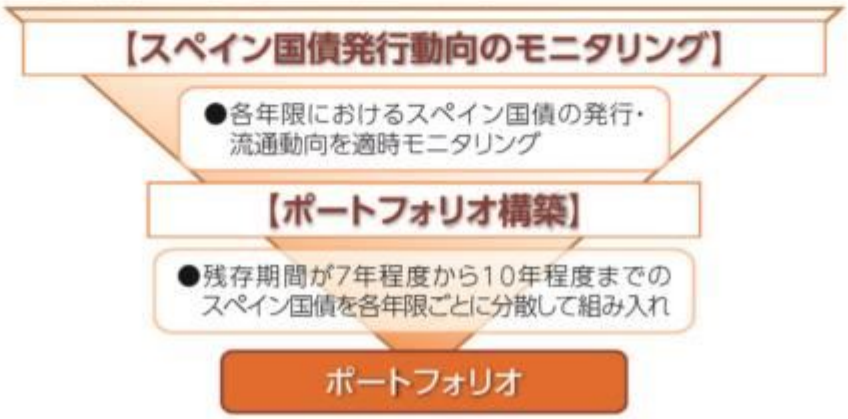
上記の運用プロセスは銘柄選定等の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄が常に上記の条件を満たすわけではありません。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。なお、今後、変更される場合があります。

<フランス国債7-10年ラダーマザーファンド>



上記は銘柄選定の視点を示したものであり、すべてを網羅するものではありません。また、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。上記のプロセスは、今後変更されることがあります。

<ヘッジ付スペイン国債7-10年ラダーマザーファンド>



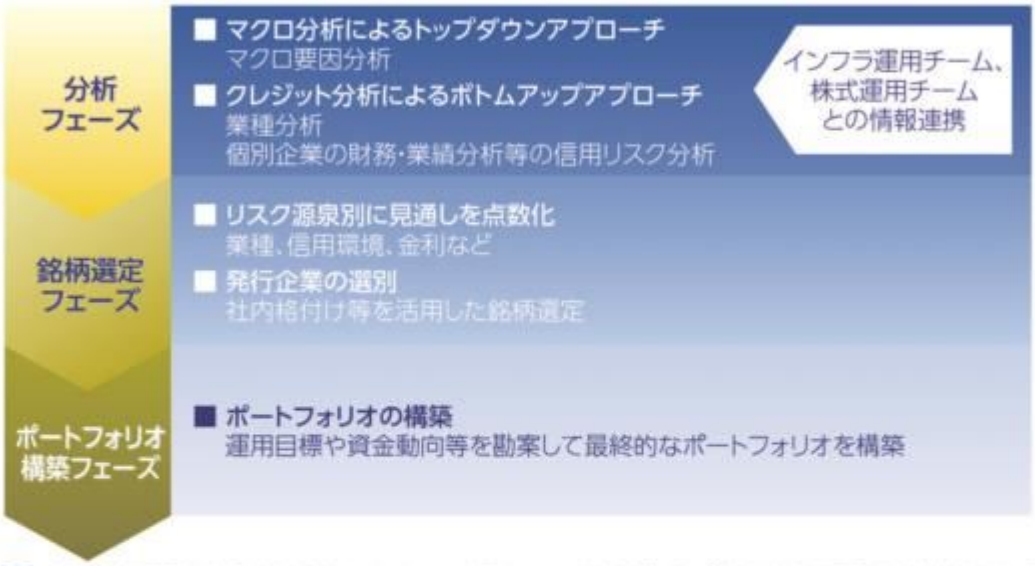
上記は銘柄選定の視点を示したものであり、すべてを網羅するものではありません。また、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。上記のプロセスは、今後変更されることがあります。

<AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>(FOFs用)(適格機関投資家限定)>

● 債券への投資にあたっては、マクロ要因分析、業種分析、個別企業の財務・業務分析等の信用リスク分析に基づき、銘柄選定を行います。

・投資する債券は、原則として取得時においてBBB−格相当以上の格付けを取得しているものに限ります。
・デュレーション調整等のため、債券先物取引等を利用する場合があります。また、ファンドの流動性等を勘案して、一部、米国国債等に投資する場合があります。

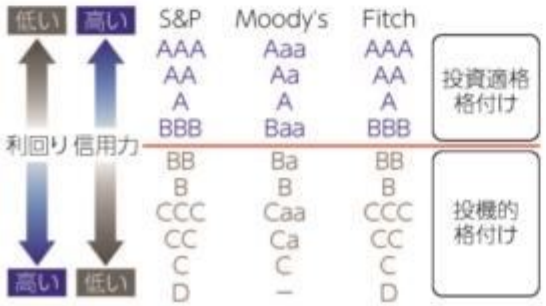
デュレーションとは、債券の投資元本の回収に要する平均残存期間や金利感応度を意味する指標です。この値が大きいほど、金利変動に対する債券価格の変動率が大きくなります。



上記は銘柄選定の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

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ができない場合があります。

<格付けとは>



S&Pグローバル・レーティング(S&P)のAAからCCCまでおよびフィッチ・レーティングス(Fitch)のAAからBまでの格付けには「+, −」、ムーディーズ・インベスターズ・サービス(Moody's)のAaからCaaまでの格付けには「1, 2, 3」という付加記号が付されることがあります。
左記は格付けと利回りの間の一般的な関係を示したイメージ図であり、利回りは格付け以外の要因によっても変動するため、この関係通りの利回りが成立しない場合があります。

指数について

・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は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE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。

・NOMURA−BPI国債 超長期(11-)とは、野村證券株式会社が発表している日本国が発行した固定利付債(個人向けは対象外)の残存期間11年以上の債券のパフォーマンスインデックスで、NOMURA−BPI国債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。

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】

2017年3月13日　　設定日、信託契約締結、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】

①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

投資対象ファンド

投資↓↑損益

有価証券等

②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。**

③委託会社の概況（2021年2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】

投資信託証券を主要投資対象とします。
投資信託証券への投資を通じて、主として日本を含む世界の債券に実質的な投資を行います。
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社の助言に基づき、投資先ファンドの投資実績全体を重視し、ファンドを選定します。
投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。
投資信託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については、原則として為替ヘッジを行います。
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）【投資対象】

①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．約束手形
　ハ．金銭債権
２．次に掲げる特定資産以外の資産
　イ．為替手形

②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、別に定める投資信託証券（投資信託および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。）ならびに投資証券および外国投資証券（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。）をいいます。以下同じ。）のほか、次に掲げるものとします。
１．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（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の新株引受権証券を除きます。）
２．コマーシャル・ペーパー
３．外国または外国の者の発行する証券または証書で、２．の証券の性質を有するもの
４．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。）
なお、１．の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は短期社債等への投資ならびに買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができます。

③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

④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

＜投資信託証券の概要＞

ファンド名	日本債券インデックスマザーファンド
形態	証券投資信託
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。
主な投資対象	NOMURA-BPI総合に採用されている公社債
主な投資制限	・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。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2001年12月5日
決算日	原則として毎年5月12日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	先進国高格付国債マザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・日本を含む先進国の国債等に投資を行い、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。 ・投資する国債等(日本国債を除きます。)は、原則として取得時において最上位格付けを取得しているものに限ります。 ・銘柄選定にあたっては、最終利回り、イールドカーブおよび為替ヘッジコスト等を勘案して決定します。 ・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為替変動リスクの低減をはかります。 ・債券等(為替ヘッジのために行う外国為替予約取引等を含みます。)の運用にあたっては、三菱UFJアセット・マネジメント(UK)に運用の指図に関する権限を委託します。 ・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。
主な投資対象	日本を含む先進国の国債等
主な投資制限	・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は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため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ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は為替変動リスクを回避するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社 (運用委託先:三菱UFJアセット・マネジメント(UK))
設定日	2012年12月20日
決算日	原則として毎年12月6日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・世界主要国の公社債(日本を除く)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)を中長期的に上回る投資成果を目指して運用を行います。 ・運用にあたっては、クオンツモデルを活用することにより主要国の各債券市場を分析し、債券の残存期間構成戦略を超過収益の源泉とします。また、為替変動リスクを回避するため、原則としてフルヘッジを行います。 ・株式への投資は、転換社債および転換社債型新株予約権付社債の転換等により取得したものに限ります。 ・なお、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。 ・また、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ならびに金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
主な投資対象	世界主要国の公社債(日本を除く)
主な投資制限	・株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、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は、信託財産の純資産総額の10%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は制限を設けません。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2000年7月19日
決算日	原則として毎年6月15日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	ショートデュレーション円インカムマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主として日本を含む先進国の債券等に投資を行います。 ・債券等への投資にあたっては、信用リスクおよび金利変動リスクに配慮しながら銘柄選定を行います。 組入債券等は、原則として取得時においてBBB−格相当以上の格付を有しているものに限ります。 ・ポートフォリオのデュレーションは、原則として0～3年程度とします。 ・デュレーション調整等のため、先物取引等を利用する場合があります。 ・債券等の組入比率は市況動向等に基づき変動します。 ・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為替変動リスクの低減をはかります。 ・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。
主な投資対象	日本を含む先進国の債券等
主な投資制限	・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20%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10%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10%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為替変動リスクを回避するため行うことができます。
運用管理費用 （信託報酬）	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2017年7月24日
決算日	原則として毎年2月20日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・わが国の公社債を主要投資対象とします。ただし、事業債、円建外債についてはBBB格(S&P、ムーディーズ、格付投資情報センターおよび日本格付研究所のいずれかから取得したもの)相当以上の格付を有する債券を対象とします。 ・NOMURA－BPI総合をベンチマークとし、これを中長期的に上回ることを目標に運用を行います。 ・経済や金利の分析をベースに、デュレーション・残存構成・債券種別等をコントロールするアクティブ運用を行います。具体的には、次のプロセスによります。 1)経済分析や市場分析等を踏まえて金利の方向性等を予測し、デュレーションに関する戦略を策定します。 2)また、同様の分析を行い金利の期間構造等を予測し、上記のデュレーション戦略を加味して、残存構成に関する戦略を策定します。 3)さらに、各債券種別間の利回り較差動向等を予測し、債券種別構成に関する戦略を策定します。 4)以上の戦略を総合して、ポートフォリオを構築します。 ・市況動向、資金動向等によっては、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の公社債
主な投資制限	・外貨建資産への投資は行いません。 ・有価証券先物取引等は約款の範囲で行います。 ・スワップ取引は約款の範囲で行います。 ・金利先渡取引は約款の範囲で行います。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2000年4月28日
決算日	原則として毎年2月15日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

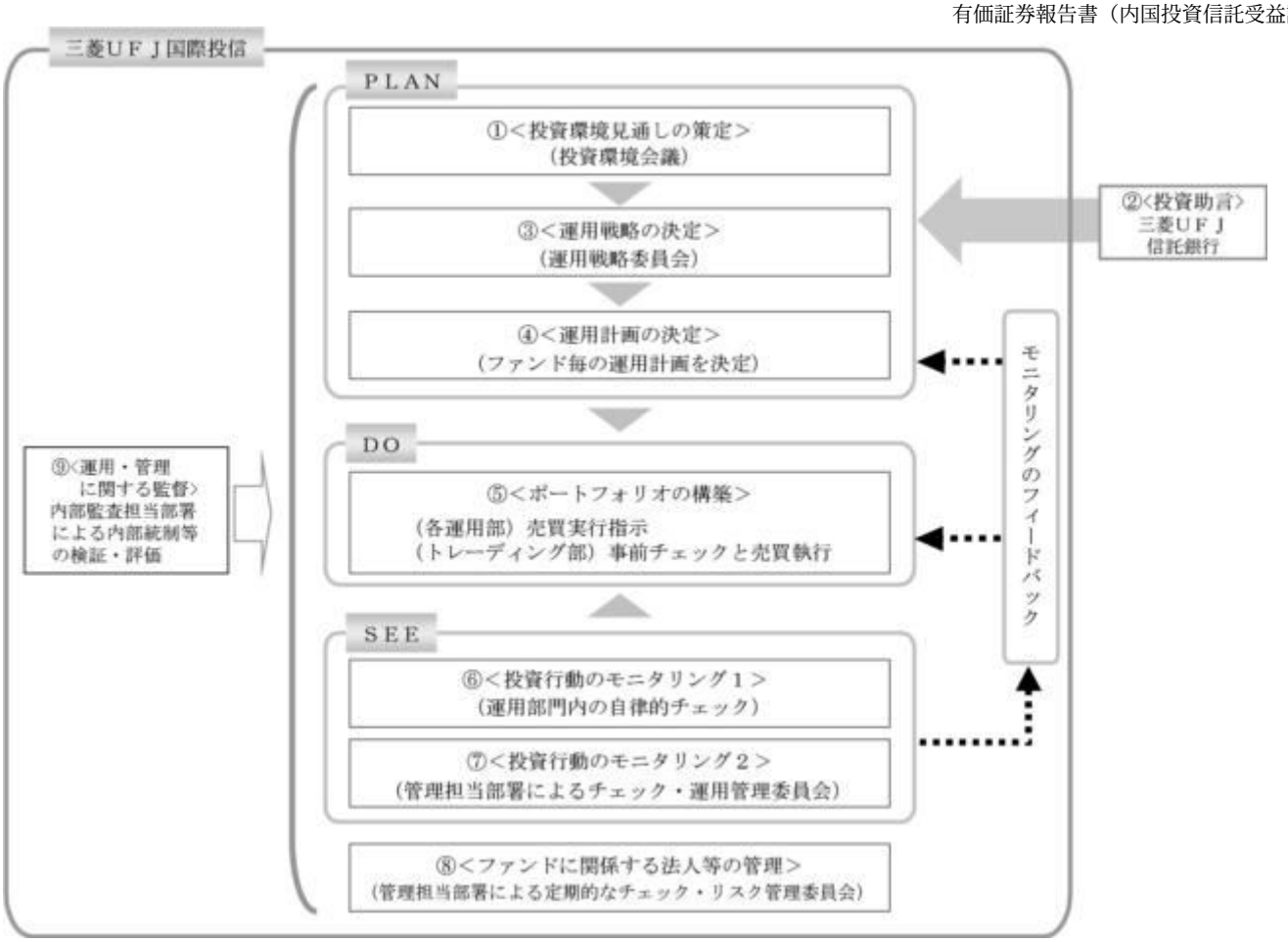
ファンド名	フランス国債7-10年ラダーマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主としてフランスの国債に投資を行います。 ・原則として、残存期間が7年程度から10年程度までのフランス国債に投資し、各残存期間ごとの投資金額が同額程度になるような運用をめざします。 ・組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	フランスの国債
主な投資制限	・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%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10%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10%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は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・スワップ取引は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は為替変動リスクを回避するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2017年6月12日
決算日	原則として毎年3月17日、9月17日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	ヘッジ付スペイン国債7-10年ラダーマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主としてスペインの国債に投資を行います。 ・原則として、残存期間が7年程度から10年程度までのスペイン国債に投資し、各残存期間ごとの投資金額が同額程度になるような運用をめざします。 ・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為替変動リスクの低減をはかります。 ・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。
主な投資対象	スペインの国債
主な投資制限	・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10%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10%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は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・スワップ取引は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避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。
運用管理費用 （信託報酬）	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2019年4月24日
決算日	原則として毎年3月17日、9月17日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	日本超長期国債インデックスマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主としてわが国の国債に投資を行います。 ・国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債券の実質投資比率が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。
主な投資対象	わが国の国債
主な投資制限	・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20%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10%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10%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。
運用管理費用 （信託報酬）	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2016年4月11日
決算日	原則として毎年5月12日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>(FOFs用)(適格機関投資家限定)
形態	証券投資信託
投資態度	・AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券に実質的な投資を行います。なお、インフラ関連企業とは、公益、通信、エネルギーおよび運輸等の日常生活に必要不可欠なサービスを提供する企業をいいます。 ・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については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。 ・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。
マザーファンドの投資態度	・世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。なお、インフラ関連企業とは、公益、通信、エネルギーおよび運輸等の日常生活に必要不可欠なサービスを提供する企業をいいます。 ・債券への投資にあたっては、マクロ要因分析、業種分析、個別企業の財務・業務分析等の信用リスク分析に基づき、銘柄選定を行います。 ・組入公社債の格付けは、原則として取得時においてBBB−格相当以上の格付を有しているものに限ります。 ・デュレーション調整等のため、債券先物取引等を利用する場合があります。また、ファンドの流動性等を勘案して、一部、米国国債等に投資する場合があります。 ・債券等の運用にあたっては、AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。 ・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。 ・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。
主な投資対象	AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド受益証券
主な投資制限	・株式への実質投資割合は、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実質投資割合は、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。)への実質投資割合は、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実質投資割合は、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実質投資割合は、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実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への実質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。
運用管理費用(信託報酬)	純資産総額の年0.3696%(税込)
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社 (マザーファンドの運用委託先:AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッド)
設定日	2015年2月20日
決算日	原則として毎年5月10日、11月10日
分配方針	毎計算期末に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①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。 ②収益分配金額は、委託者が基準価額水準、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。 ③収益の分配にあてなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

（３）【運用体制】



①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。
②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。
③運用戦略の決定
運用戦略委員会において、①で策定された投資環境見通し、および②の投資助言に沿って運用戦略を決定します。
④運用計画の決定
③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。
⑤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。
⑥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。
⑦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。
⑧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。
⑨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。
①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。
②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。
③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＞
①株式
株式への直接投資は行いません。
②投資信託証券
投資信託証券への投資割合に制限を設けません。
③信用取引
信用取引の指図は行いません。
④外国為替予約取引
委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、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。
⑤公社債の借入れ
ａ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債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、当該借入れに係る公社債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．の借入れに係る公社債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公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
⑥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。
⑦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。

⑧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。

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、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、ファンドはその影響を受け組入公社債の価格の下落は基準価額の下落要因となります。
為替変動リスク	組入外貨建資産については、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図りますが、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。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のヘッジコストがかかることにご留意ください。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。
信用リスク	組入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は、当該組入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・償還金の支払いが滞ることがあります。
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場合または取引が不可能となる場合、市場実勢から期待される価格より不利な価格での取引となる可能性があります。

※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小さかった場合も同様です。
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。

（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、定期的に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。
①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。
②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。
③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。
④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。**

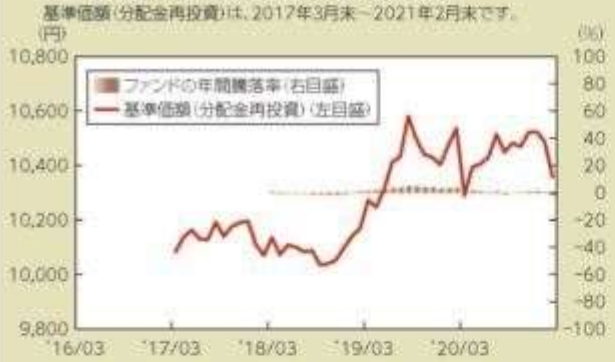
＊組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■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、2018年3月～2021年2月です。
基準価額(分配金再投資)は、2017年3月末～2021年2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

(2016年3月末～2021年2月末)
ファンドの年間騰落率は、2018年3月～2021年2月です。

(注)全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

- 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して計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率とは、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0.385%（税抜0.35%）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	0.28%	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	0.04%	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。

受益者が負担する実質的な信託報酬率（概算値）は、次の通りとなります。

実質的な信託報酬率（概算値）	うち投資信託証券に係る率
年0.385%～0.445%（税込）程度	年0%～0.06%（税込）程度*

＊ファンドが投資対象とする投資信託証券の信託報酬は最大年率0.3696%（税込）

（注）上記概算値は、投資対象とする投資信託証券における信託報酬率を含めた実質的な信託報酬率を算出したものです（2021年５月１日現在）。各投資信託証券への投資比率が変動する可能性や投資信託証券の変更の可能性があること、また別途成功報酬がかかる投資信託証券が含まれる場合があることから、実質的な信託報酬率は変動します。したがって事前に固定の料率、上限額等を表示することはできません。

＜投資信託証券の信託報酬率＞

投資信託証券の名称	信託報酬率（税抜）
日本債券インデックスマザーファンド	－
先進国高格付国債マザーファンド	－ 外部委託報酬：純資産総額の年0.125%以内
ＭＵＡＭ ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド	－
ショートデュレーション円インカムマザーファンド	－
三菱ＵＦＪ 国内債券アクティブマザーファンド	－
フランス国債7-10年ラダーマザーファンド	－
ヘッジ付スペイン国債7-10年ラダーマザーファンド	－
日本超長期国債インデックスマザーファンド	－

ＡＭＰ グローバル・インフラ債券ファンド＜為替ヘッジあり＞（ＦＯＦｓ用） （適格機関投資家限定）	年0.336% 外部委託報酬：マザーファンドの純資産総額の年0.33%
ＡＭＰ グローバル・インフラ債券マザーファンド	－

※上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかる場合があります。

上記の信託報酬率は、今後変更となる場合があります。上記の他、監査費用等の諸費用が別途かかります。申込手数料はかかりません。

（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、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。
①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。
②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。

※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
①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。
②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。
③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、①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、②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2021年2月末現在のものですので、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】

【国内債券セレクション（ラップ向け）】

（1）【投資状況】

令和 3年 2月26日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（%）
投資信託受益証券	日本	2,513,579,100	10.37
親投資信託受益証券	日本	21,226,048,463	87.55
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	504,576,071	2.08
純資産総額		24,244,203,634	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】

①【投資有価証券の主要銘柄】

ａ評価額上位３０銘柄

令和 3年 2月26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	5,355,360,890	1.3437	7,196,009,772	1.3326	7,136,553,922	29.44
日本	親投資信託受益証券	ショートデュレーション円インカムマザーファンド	5,606,271,748	0.9703	5,439,771,020	0.9700	5,438,083,595	22.43
日本	親投資信託受益証券	三菱ＵＦＪ　国内債券アクティブマザーファンド	3,276,163,305	1.4645	4,798,232,867	1.4520	4,756,989,118	19.62
日本	投資信託受益証券	ＡＭＰ グローバル・インフラ債券ファンド＜為替ヘッジあり＞（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	2,210,128,463	1.1723	2,590,940,506	1.1373	2,513,579,100	10.37
日本	親投資信託受益証券	ＭＵＡＭ　ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド	1,157,380,196	1.7703	2,048,938,616	1.7338	2,006,665,783	8.28
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付スペイン国債７－１０年ラダーマザーファンド	881,486,071	1.0934	963,823,237	1.0716	944,600,473	3.90
日本	親投資信託受益証券	フランス国債７－１０年ラダーマザーファンド	419,856,157	1.1483	482,137,243	1.1259	472,716,047	1.95
日本	親投資信託受益証券	先進国高格付国債マザーファンド	416,355,010	1.1584	482,310,501	1.1299	470,439,525	1.94

（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 3年 2月26日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	10.37
親投資信託受益証券	87.55
合計	97.92

（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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

①【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和3年2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30年 2月 5日)	11,105,960,848	11,105,960,848	10,075	10,075
第2計算期間末日　(平成31年 2月 5日)	16,779,646,867	16,779,646,867	10,153	10,153
第3計算期間末日　(令和 2年 2月 5日)	19,288,687,531	19,288,687,531	10,452	10,452
第4計算期間末日　(令和 3年 2月 5日)	24,115,146,293	24,115,146,293	10,473	10,473
令和 2年 2月末日	19,461,568,255	—	10,536	—
3月末日	16,888,973,182	—	10,290	—
4月末日	17,155,072,531	—	10,395	—
5月末日	16,072,374,520	—	10,405	—
6月末日	16,496,372,154	—	10,431	—
7月末日	17,833,114,027	—	10,514	—
8月末日	18,268,850,833	—	10,449	—
9月末日	18,961,334,925	—	10,482	—
10月末日	20,565,361,700	—	10,469	—
11月末日	21,867,470,967	—	10,521	—
12月末日	22,746,164,930	—	10,524	—
令和 3年 1月末日	23,954,316,574	—	10,488	—
2月末日	24,244,203,634	—	10,358	—

②【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

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第1計算期間	0.75
第2計算期間	0.77
第3計算期間	2.94
第4計算期間	0.20

（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	12,571,701,220	1,548,474,323	11,023,226,897
第2計算期間	8,904,288,458	3,400,559,093	16,526,956,262
第3計算期間	5,442,609,493	3,515,542,243	18,454,023,512
第4計算期間	11,312,543,909	6,741,276,409	23,025,291,012

（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 3年 2月26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	278,523,315,810	83.84
地方債証券	日本	16,062,251,202	4.83
特殊債券	日本	20,476,208,342	6.16
社債券	日本	15,104,339,500	4.55
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	2,055,398,738	0.62
純資産総額		332,221,513,592	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 3年 2月26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	903,720,000	0.27

（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 3年 2月26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１４４回利付国債（５年）	4,690,000,000	100.95	4,734,722,000	100.73	4,724,377,700	0.100000	2025/6/20	1.42
日本	国債証券	第３５９回利付国債（１０年）	4,240,000,000	100.71	4,270,364,200	99.67	4,226,347,200	0.100000	2030/6/20	1.27
日本	国債証券	第１３４回利付国債（５年）	4,140,000,000	100.69	4,168,566,000	100.38	4,156,063,200	0.100000	2022/12/20	1.25
日本	国債証券	第３３３回利付国債（１０年）	3,550,000,000	102.92	3,653,660,000	102.14	3,626,041,000	0.600000	2024/3/20	1.09
日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	3,600,000,000	100.69	3,625,174,000	100.61	3,622,284,000	0.100000	2023/12/20	1.09
日本	国債証券	第３６０回利付国債（１０年）	3,340,000,000	100.73	3,364,678,000	99.52	3,324,235,200	0.100000	2030/9/20	1.00
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	3,250,000,000	101.33	3,293,542,900	100.16	3,255,200,000	0.100000	2029/3/20	0.98
日本	国債証券	第３２９回利付国債（１０年）	3,160,000,000	103.01	3,255,116,000	102.09	3,226,044,000	0.800000	2023/6/20	0.97
日本	国債証券	第３４８回利付国債（１０年）	3,080,000,000	101.47	3,125,374,000	100.55	3,097,124,800	0.100000	2027/9/20	0.93
日本	国債証券	第３５６回利付国債（１０年）	3,000,000,000	101.21	3,036,516,000	99.95	2,998,710,000	0.100000	2029/9/20	0.90
日本	国債証券	第３３４回利付国債（１０年）	2,830,000,000	103.09	2,917,447,000	102.28	2,894,693,800	0.600000	2024/6/20	0.87
日本	国債証券	第１３６回利付国債（５年）	2,810,000,000	100.65	2,828,412,900	100.48	2,823,628,500	0.100000	2023/6/20	0.85
日本	国債証券	第１４５回利付国債（５年）	2,730,000,000	101.01	2,757,648,400	100.75	2,750,584,200	0.100000	2025/9/20	0.83
日本	国債証券	第３４５回利付国債（１０年）	2,730,000,000	101.35	2,766,957,200	100.66	2,748,236,400	0.100000	2026/12/20	0.83
日本	国債証券	第３５１回利付国債（１０年）	2,660,000,000	101.55	2,701,230,000	100.40	2,670,640,000	0.100000	2028/6/20	0.80
日本	国債証券	第３４３回利付国債（１０年）	2,620,000,000	101.33	2,654,846,000	100.71	2,638,785,400	0.100000	2026/6/20	0.79
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	2,540,000,000	101.36	2,574,648,500	100.23	2,545,892,800	0.100000	2028/12/20	0.77
日本	国債証券	第３３５回利付国債（１０年）	2,470,000,000	102.82	2,539,654,000	102.08	2,521,524,200	0.500000	2024/9/20	0.76
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	2,510,000,000	101.50	2,547,859,600	100.45	2,521,470,700	0.100000	2028/3/20	0.76
日本	国債証券	第１４６回利付国債（５年）	2,460,000,000	100.85	2,480,954,500	100.74	2,478,351,600	0.100000	2025/12/20	0.75
日本	国債証券	第１４２回利付国債（５年）	2,420,000,000	101.04	2,445,298,000	100.68	2,436,625,400	0.100000	2024/12/20	0.73
日本	国債証券	第３３６回利付国債（１０年）	2,380,000,000	102.94	2,449,972,000	102.19	2,432,217,200	0.500000	2024/12/20	0.73
日本	国債証券	第３５５回利付国債（１０年）	2,410,000,000	100.97	2,433,406,800	100.08	2,411,976,200	0.100000	2029/6/20	0.73
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	2,370,000,000	101.36	2,402,445,500	100.63	2,385,049,500	0.100000	2027/3/20	0.72
日本	国債証券	第１４０回利付国債（５年）	2,360,000,000	100.97	2,383,102,000	100.64	2,375,245,600	0.100000	2024/6/20	0.71
日本	国債証券	第４１８回利付国債（２年）	2,360,000,000	100.48	2,371,402,600	100.38	2,369,086,000	0.100000	2022/11/1	0.71
日本	国債証券	第３２５回利付国債（１０年）	2,335,000,000	102.30	2,388,705,000	101.42	2,368,297,100	0.800000	2022/9/20	0.71
日本	国債証券	第３５８回利付国債（１０年）	2,370,000,000	100.74	2,387,690,600	99.77	2,364,691,200	0.100000	2030/3/20	0.71
日本	国債証券	第１４３回利付国債（５年）	2,340,000,000	100.99	2,363,188,500	100.71	2,356,637,400	0.100000	2025/3/20	0.71
日本	国債証券	第３５７回利付国債（１０年）	2,340,000,000	100.91	2,361,420,500	99.86	2,336,934,600	0.100000	2029/12/20	0.70

（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 3年 2月26日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	83.84
地方債証券	4.83
特殊債券	6.16
社債券	4.55
合計	99.38

（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 3年 2月26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２１年０３月限	買建	6	円	909,866,600	903,720,000	0.27

（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。

先進国高格付国債マザーファンド

投資状況

令和 3年 2月26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	オーストラリア	37,418,690,890	39.58
	シンガポール	19,125,510,390	20.23
	カナダ	18,713,331,418	19.80
	ノルウェー	18,684,909,980	19.77
	小計	93,942,442,678	99.38
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	—	585,618,070	0.62
純資産総額		94,528,060,748	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 3年 2月26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(%)
シンガポール	国債証券	2.875 SINGAPORGOV 290701	153,000,000	9,320.19	14,259,894,264	9,077.13	13,888,015,785	2.875000	2029/7/1	14.69
オーストラリア	国債証券	4.75 AUST GOVT 270421	132,000,000	10,545.54	13,920,120,174	10,198.73	13,462,334,890	4.750000	2027/4/21	14.24
カナダ	国債証券	1.25 CAN GOVT 300601	144,000,000	8,773.48	12,633,815,302	8,333.99	12,000,948,076	1.250000	2030/6/1	12.70
ノルウェー	国債証券	1.75 NORWE GOVT 290906	867,000,000	1,340.57	11,622,756,812	1,274.56	11,050,479,243	1.750000	2029/9/6	11.69
オーストラリア	国債証券	3.25 AUST GOVT 290421	116,000,000	9,984.77	11,582,343,036	9,514.25	11,036,535,138	3.250000	2029/4/21	11.68
ノルウェー	国債証券	2 NORWE GOVT 280426	586,000,000	1,356.87	7,951,273,307	1,302.80	7,634,430,737	2.000000	2028/4/26	8.08
オーストラリア	国債証券	2.5 AUST GOVT 300521	83,000,000	9,514.98	7,897,438,981	8,981.89	7,454,971,632	2.500000	2030/5/21	7.89
カナダ	国債証券	2.25 CAN GOVT 290601	74,000,000	9,485.23	7,019,076,390	9,070.78	6,712,383,342	2.250000	2029/6/1	7.10
シンガポール	国債証券	2.625 SINGAPORGOV 280501	59,000,000	9,057.13	5,343,707,880	8,877.10	5,237,494,605	2.625000	2028/5/1	5.54
オーストラリア	国債証券	4.25 AUST GOVT 260421	53,000,000	10,047.18	5,325,008,580	9,806.50	5,197,448,573	4.250000	2026/4/21	5.50
オーストラリア	国債証券	2.25 AUST GOVT 280521	3,000,000	9,287.39	278,621,964	8,913.35	267,400,657	2.250000	2028/5/21	0.28

（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 3年 2月26日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	99.38
合計	99.38

（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。

ＭＵＡＭ　ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド

投資状況

令和 3年 2月26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	70,587,676,396	40.34
	イタリア	21,290,374,763	12.17
	ドイツ	14,761,299,167	8.43
	スペイン	14,653,311,147	8.37
	フランス	14,495,416,789	8.28
	イギリス	10,281,745,003	5.88
	スウェーデン	8,115,553,004	4.64
	オーストリア	5,344,019,709	3.05
	オランダ	3,618,368,596	2.07
	アイルランド	3,055,897,032	1.75
	ベルギー	2,574,134,601	1.47
	ポーランド	1,284,427,561	0.73
	フィンランド	924,653,454	0.53
	小計	170,986,877,222	97.71
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	—	4,013,726,658	2.29
純資産総額		175,000,603,880	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 3年 2月26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(%)
イタリア	国債証券	0.6 ITALY GOVT 230615	70,800,000	13,172.45	9,326,101,019	13,159.46	9,316,903,369	0.600000	2023/6/15	5.32
アメリカ	国債証券	1.75 T-NOTE 220715	71,300,000	10,904.29	7,774,760,326	10,861.15	7,744,005,099	1.750000	2022/7/15	4.43
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 250131	61,600,000	11,110.12	6,843,838,917	10,958.69	6,750,553,906	1.375000	2025/1/31	3.86
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 230215	59,700,000	10,922.29	6,520,607,323	10,875.26	6,492,535,324	1.375000	2023/2/15	3.71
アメリカ	国債証券	0.25 T-NOTE 250630	56,700,000	10,622.03	6,022,692,847	10,436.57	5,917,536,474	0.250000	2025/6/30	3.38
アメリカ	国債証券	1.375 T-BOND 401115	63,600,000	10,474.75	6,661,944,727	9,219.67	5,863,715,039	1.375000	2040/11/15	3.35
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 231231	45,100,000	11,377.88	5,131,424,267	11,204.39	5,053,181,933	2.250000	2023/12/31	2.89
アメリカ	国債証券	0.25 T-NOTE 230615	46,000,000	10,642.05	4,895,345,898	10,628.73	4,889,218,259	0.250000	2023/6/15	2.79
スウェーデン	国債証券	1.5 SWD GOVT 231113	357,700,000	1,347.32	4,819,379,343	1,338.12	4,786,490,974	1.500000	2023/11/13	2.74
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 270131	43,600,000	11,319.31	4,935,220,361	10,940.42	4,770,027,344	1.500000	2027/1/31	2.73

フランス	国債証券	4.5 O.A.T 410425	19,400,000	23,451.42	4,549,577,382	22,892.74	4,441,191,861	4.500000	2041/4/25	2.54
アメリカ	国債証券	0.125 T-NOTE 230915	40,900,000	10,602.70	4,336,507,838	10,587.23	4,330,177,658	0.125000	2023/9/15	2.47
イタリア	国債証券	5 ITALY GOVT 390801	20,100,000	18,778.41	3,774,460,410	20,666.19	4,153,905,306	5.000000	2039/8/1	2.37
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 240715	30,800,000	13,220.07	4,071,782,308	13,146.57	4,049,146,291	0.000000	2024/7/15	2.31
スペイン	国債証券	1.3 SPAIN GOVT 261031	28,700,000	14,004.65	4,019,336,559	13,928.56	3,997,499,360	1.300000	2026/10/31	2.28
イギリス	国債証券	1.25 GILT 411022	25,100,000	16,408.76	4,118,600,601	14,626.84	3,671,337,344	1.250000	2041/10/22	2.10
ドイツ	国債証券	5.5 BUND 310104	17,900,000	21,144.82	3,784,923,743	20,422.64	3,655,653,362	5.500000	2031/1/4	2.09
アメリカ	国債証券	0.5 T-NOTE 270531	35,100,000	10,632.45	3,731,992,652	10,266.40	3,603,508,593	0.500000	2027/5/31	2.06
スウェーデン	国債証券	0.125 SWD GOVT 310512	269,700,000	1,288.03	3,473,825,756	1,234.35	3,329,062,030	0.125000	2031/5/12	1.90
アメリカ	国債証券	3.125 T-NOTE 281115	27,200,000	12,628.55	3,434,966,293	12,070.16	3,283,085,155	3.125000	2028/11/15	1.88
フランス	国債証券	0.5 O.A.T 400525	24,000,000	13,663.09	3,279,141,747	12,890.20	3,093,648,768	0.500000	2040/5/25	1.77
オランダ	国債証券	0.5 NETH GOVT 260715	21,500,000	13,722.94	2,950,433,170	13,593.28	2,922,555,820	0.500000	2026/7/15	1.67
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300515	27,500,000	10,639.80	2,925,945,205	9,875.43	2,715,745,849	0.625000	2030/5/15	1.55
ドイツ	国債証券	0.25 BUND 270215	19,500,000	13,764.06	2,683,992,458	13,511.41	2,634,725,866	0.250000	2027/2/15	1.51
ドイツ	国債証券	0.5 BUND 250215	18,800,000	13,669.91	2,569,944,226	13,495.01	2,537,062,378	0.500000	2025/2/15	1.45
スペイン	国債証券	0 SPAIN GOVT 250131	19,100,000	13,071.73	2,496,701,324	13,043.93	2,491,390,715	0.000000	2025/1/31	1.42
アメリカ	国債証券	1.25 T-BOND 500515	29,600,000	10,507.63	3,110,261,231	8,214.45	2,431,478,125	1.250000	2050/5/15	1.39
アメリカ	国債証券	3 T-BOND 441115	19,900,000	14,125.93	2,811,061,563	12,109.17	2,409,726,758	3.000000	2044/11/15	1.38
スペイン	国債証券	4.7 SPAIN GOVT 410730	10,700,000	21,409.19	2,290,783,918	21,624.00	2,313,768,315	4.700000	2041/7/30	1.32
イタリア	国債証券	2.8 ITALY GOVT 281201	14,700,000	14,478.46	2,128,334,218	15,144.77	2,226,281,888	2.800000	2028/12/1	1.27

（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 3年 2月26日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	97.71
合計	97.71

（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。

ショートデュレーション円インカムマザーファンド

投資状況

令和 3年 2月26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	840,906,820	10.88
	フランス	231,133,123	2.99
	アメリカ	106,187,743	1.37
	小計	1,178,227,686	15.25
地方債証券	カナダ	87,311,487	1.13
特殊債券	ドイツ	332,533,870	4.30
	カナダ	271,979,014	3.52
	オーストラリア	141,614,799	1.83
	アメリカ	129,834,401	1.68
	小計	875,962,084	11.34
社債券	オーストラリア	1,243,746,987	16.10
	アメリカ	527,455,433	6.83
	イギリス	466,142,488	6.03
	スウェーデン	375,916,025	4.87
	カナダ	174,859,268	2.26
	ドイツ	131,575,179	1.70
	日本	101,693,000	1.32
	小計	3,021,388,380	39.11
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	—	2,562,884,129	33.17
純資産総額		7,725,773,766	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 3年 2月26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	売建	アメリカ	323,987,805	△4.19
	売建	カナダ	188,348,145	△2.44
	売建	ドイツ	290,559,087	△3.76
	売建	オーストラリア	208,525,656	△2.70

（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 3年 2月26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９６０回国庫短期証券	340,000,000	100.10	340,362,440	100.10	340,356,320	—	2021/12/20	4.41
日本	国債証券	第９６６回国庫短期証券	300,000,000	100.12	300,366,600	100.12	300,360,900	—	2022/1/20	3.89
オーストラリア	社債券	3.85 GENERAL MOTO 230221	3,000,000	8,773.28	263,198,434	8,767.51	263,025,532	3.850000	2023/2/21	3.40
フランス	国債証券	1.75 O.A.T 230525	1,700,000	13,613.37	231,427,436	13,596.06	231,133,123	1.750000	2023/5/25	2.99
オーストラリア	社債券	3.45 AT&T INC 230919	2,500,000	8,927.11	223,177,763	8,901.82	222,545,711	3.450000	2023/9/19	2.88
日本	国債証券	第９５２回国庫短期証券	200,000,000	100.09	200,193,200	100.09	200,189,600	—	2021/11/22	2.59
スウェーデン	社債券	1.25 SWEDISH COVE 220615	15,000,000	1,299.63	194,945,856	1,299.11	194,867,397	1.250000	2022/6/15	2.52
ドイツ	特殊債券	0.2 LB BADEN-WUER 211213	1,500,000	12,974.40	194,616,135	12,976.42	194,646,356	0.200000	2021/12/13	2.52
スウェーデン	社債券	1.5 STADSHYPOTEK 211215	14,000,000	1,293.64	181,110,092	1,293.20	181,048,628	1.500000	2021/12/15	2.34
カナダ	特殊債券	1.9 IBRD 250116	2,000,000	8,801.27	176,025,596	8,725.01	174,500,204	1.900000	2025/1/16	2.26
オーストラリア	社債券	FRN NATIONAL A 230316	2,000,000	8,419.92	168,398,469	8,415.74	168,314,992	0.664100	2023/3/16	2.18
イギリス	社債券	1.875 VOLKSWAGEN 210907	1,100,000	14,954.72	164,502,001	14,953.09	164,484,035	1.875000	2021/9/7	2.13
イギリス	社債券	2.125 BAT CAPITAL 250815	1,000,000	15,453.32	154,533,233	15,400.93	154,009,395	2.125000	2025/8/15	1.99
オーストラリア	社債券	3 ING BANK (AUSTR 230907	1,700,000	8,868.18	150,759,080	8,846.88	150,397,096	3.000000	2023/9/7	1.95
イギリス	社債券	2.519 BP CAPITAL 280407	1,000,000	14,872.24	148,722,424	14,764.90	147,649,058	2.519000	2028/4/7	1.91
オーストラリア	特殊債券	4 KFW 250227	1,500,000	9,499.33	142,490,041	9,440.98	141,614,799	4.000000	2025/2/27	1.83
ドイツ	特殊債券	1.5 KFW 240611	1,000,000	13,814.54	138,145,439	13,788.75	137,887,514	1.500000	2024/6/11	1.78
オーストラリア	社債券	1.125 VICINITY CE 291107	1,000,000	13,312.54	133,125,496	13,225.03	132,250,375	1.125000	2029/11/7	1.71
ドイツ	社債券	0.75 BAYER AG 270106	1,000,000	13,221.82	132,218,294	13,157.51	131,575,179	0.750000	2027/1/6	1.70
アメリカ	特殊債券	1.75 ASIAN DEV 290919	1,200,000	10,972.69	131,672,344	10,819.53	129,834,401	1.750000	2029/9/19	1.68
アメリカ	社債券	4.75 ENI SPA 280912	1,000,000	12,614.73	126,147,330	12,450.99	124,509,912	4.750000	2028/9/12	1.61
アメリカ	社債券	4 ANHEUSER-BUSCH 280413	1,000,000	12,170.20	121,702,017	12,022.58	120,225,834	4.000000	2028/4/13	1.56
アメリカ	社債券	3.625 SCENTRE GRO 260128	1,000,000	11,642.69	116,426,933	11,492.87	114,928,776	3.625000	2026/1/28	1.49
アメリカ	社債券	2.512 SUMITOMO MI 250122	1,000,000	11,123.04	111,230,448	11,088.62	110,886,240	2.512000	2025/1/22	1.44
アメリカ	国債証券	0.125 T-NOTE 221130	1,000,000	10,627.90	106,279,051	10,618.77	106,187,743	0.125000	2022/11/30	1.37
日本	社債券	第３４回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101.71	101,712,000	101.69	101,693,000	0.750000	2025/4/23	1.32
カナダ	特殊債券	4.55 EUROFIMA 270330	1,000,000	9,892.68	98,926,840	9,747.88	97,478,810	4.550000	2027/3/30	1.26

カナダ	社債券	2.975 WELLS FARGO 260519	1,000,000	9,023.10	90,231,093	8,901.01	89,010,106	2.975000	2026/5/19	1.15
カナダ	地方債証券	2.3 QUEBEC 290901	1,000,000	8,907.65	89,076,536	8,731.14	87,311,487	2.300000	2029/9/1	1.13
カナダ	社債券	FRN GOLDMAN SA 230426	1,000,000	8,594.58	85,945,865	8,584.91	85,849,162	2.433000	2023/4/26	1.11

（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 3年 2月26日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	15.25
地方債証券	1.13
特殊債券	11.34
社債券	39.11
合計	66.83

（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 3年 2月26日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（%）
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	NOTE10Y 2106	売建	23	アメリカドル	3,090,058.51	328,318,717	3,049,296.99	323,987,805	△4.19
	カナダ	モントリオール取引所	CAN-B 2106	売建	16	カナダドル	2,280,160	191,738,654	2,239,840	188,348,145	△2.44
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-B 2103	売建	13	ユーロ	2,264,340	292,439,511	2,249,780	290,559,087	△3.76
	オーストラリア	シドニー先物取引所	AUST10Y 2103	売建	18	オーストラリアドル	2,562,922.98	213,517,113	2,503,008.72	208,525,656	△2.70

（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。

三菱ＵＦＪ　国内債券アクティブマザーファンド

投資状況

令和 3年 2月26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	7,098,431,000	58.96
社債券	日本	4,299,729,000	35.72
	スイス	100,002,000	0.83
	小計	4,399,731,000	36.55
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	540,278,255	4.49
純資産総額		12,038,440,255	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 3年 2月26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３６０回利付国債（１０年）	290,000,000	100.24	290,704,400	99.52	288,631,200	0.100000	2030/9/20	2.40
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	260,000,000	100.84	262,207,400	100.16	260,416,000	0.100000	2029/3/20	2.16
日本	国債証券	第１６６回利付国債（２０年）	220,000,000	105.01	231,035,200	103.47	227,651,600	0.700000	2038/9/20	1.89
日本	社債券	第3回マラヤン・バンキング（２０１９）	200,000,000	100.02	200,042,000	100.00	200,016,000	0.270000	2022/5/20	1.66
日本	社債券	第7回イオンフィナンシャルサービス	200,000,000	99.83	199,674,000	99.83	199,678,000	0.190000	2023/3/20	1.66
日本	社債券	第6回マラヤン・バンキング	200,000,000	99.72	199,458,000	99.70	199,410,000	0.224000	2023/2/13	1.66
日本	国債証券	第１６２回利付国債（２０年）	180,000,000	103.75	186,762,600	102.39	184,302,000	0.600000	2037/9/20	1.53
日本	国債証券	第１３０回利付国債（２０年）	150,000,000	117.75	176,632,500	116.78	175,173,000	1.800000	2031/9/20	1.46
日本	国債証券	第１５３回利付国債（２０年）	140,000,000	114.45	160,238,400	113.09	158,333,000	1.300000	2035/6/20	1.32
日本	国債証券	第１５２回利付国債（２０年）	140,000,000	113.00	158,205,600	111.68	156,356,200	1.200000	2035/3/20	1.30
日本	国債証券	第１２５回利付国債（２０年）	130,000,000	121.21	157,578,200	120.18	156,235,300	2.200000	2031/3/20	1.30
日本	国債証券	第１４６回利付国債（２０年）	130,000,000	118.64	154,234,600	117.43	152,668,100	1.700000	2033/9/20	1.27
日本	国債証券	第５８回利付国債（３０年）	140,000,000	104.03	145,651,000	102.27	143,183,600	0.800000	2048/3/20	1.19
日本	国債証券	第１５５回利付国債（２０年）	130,000,000	110.25	143,336,700	108.91	141,594,700	1.000000	2035/12/20	1.18
日本	国債証券	第１２８回利付国債（２０年）	120,000,000	118.48	142,177,200	117.51	141,022,800	1.900000	2031/6/20	1.17
日本	国債証券	第１５０回利付国債（２０年）	120,000,000	115.49	138,595,200	114.25	137,104,800	1.400000	2034/9/20	1.14
日本	国債証券	第１２３回利付国債（２０年）	110,000,000	119.84	131,824,000	118.84	130,727,300	2.100000	2030/12/20	1.09
日本	国債証券	第１４５回利付国債（２０年）	110,000,000	118.42	130,262,000	117.23	128,961,800	1.700000	2033/6/20	1.07

日本	国債証券	第１４９回利付国債（２０年）	110,000,000	116.66	128,329,300	115.42	126,968,600	1.500000	2034/6/20	1.05
日本	国債証券	第１５９回利付国債（２０年）	120,000,000	104.14	124,971,600	102.74	123,292,800	0.600000	2036/12/20	1.02
日本	国債証券	第１４３回利付国債（２０年）	100,000,000	117.00	117,006,000	115.86	115,862,000	1.600000	2033/3/20	0.96
日本	国債証券	第６７回利付国債（３０年）	120,000,000	98.04	117,651,600	96.16	115,398,000	0.600000	2050/6/20	0.96
日本	国債証券	第６０回利付国債（３０年）	110,000,000	106.47	117,118,100	104.49	114,948,900	0.900000	2048/9/20	0.95
日本	国債証券	第１５４回利付国債（２０年）	100,000,000	113.13	113,135,000	111.77	111,772,000	1.200000	2035/9/20	0.93
日本	国債証券	第１４１回利付国債（２０年）	90,000,000	117.84	106,062,200	116.82	105,145,200	1.700000	2032/12/20	0.87
日本	国債証券	第１３２回利付国債（２０年）	90,000,000	116.97	105,273,900	115.98	104,389,200	1.700000	2031/12/20	0.87
日本	国債証券	第５４回利付国債（３０年）	100,000,000	104.51	104,511,000	102.65	102,655,000	0.800000	2047/3/20	0.85
日本	社債券	第５００回関西電力	100,000,000	101.38	101,386,000	101.30	101,302,000	0.455000	2026/3/19	0.84
日本	社債券	第２７回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101.17	101,173,000	101.14	101,146,000	0.600000	2024/7/10	0.84
日本	社債券	第３８回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101.04	101,047,000	100.98	100,982,000	0.580000	2025/7/16	0.84

（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 3年 2月26日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	58.96
社債券	36.55
合計	95.51

（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。

フランス国債７－１０年ラダーマザーファンド

投資状況

令和 3年 2月26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	フランス	20,343,159,666	98.94
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	217,606,453	1.06
純資産総額		20,560,766,119	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 3年 2月26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(%)
フランス	国債証券	0 O.A.T 291125	26,220,000	13,270.16	3,479,436,607	12,981.57	3,403,769,443	0.000000	2029/11/25	16.55
フランス	国債証券	0.75 O.A.T 281125	24,601,000	14,121.26	3,473,971,418	13,833.35	3,403,144,848	0.750000	2028/11/25	16.55
フランス	国債証券	0.75 O.A.T 280525	24,592,000	14,079.93	3,462,537,124	13,816.62	3,397,783,677	0.750000	2028/5/25	16.53
フランス	国債証券	0.5 O.A.T 290525	25,028,000	13,870.71	3,471,561,299	13,565.83	3,395,258,062	0.500000	2029/5/25	16.51
フランス	国債証券	0 O.A.T 301125	26,310,000	13,305.03	3,500,554,182	12,888.08	3,390,855,200	0.000000	2030/11/25	16.49
フランス	国債証券	2.5 O.A.T 300525	21,010,000	16,443.37	3,454,753,718	15,955.96	3,352,348,436	2.500000	2030/5/25	16.30

（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 3年 2月26日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.94
合計	98.94

（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。

ヘッジ付スペイン国債７－１０年ラダーマザーファンド

投資状況

令和 3年 2月26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	スペイン	13,571,145,239	99.34
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	90,646,421	0.66
純資産総額		13,661,791,660	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 3年 2月26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(%)
スペイン	国債証券	1.4 SPAIN GOVT 280430	32,120,000	14,280.14	4,586,784,140	14,094.24	4,527,070,792	1.400000	2028/4/30	33.14
スペイン	国債証券	0.5 SPAIN GOVT 300430	34,580,000	13,287.37	4,594,775,311	13,091.40	4,527,008,191	0.500000	2030/4/30	33.14
スペイン	国債証券	1.45 SPAIN GOVT 290430	31,840,000	14,392.99	4,582,730,787	14,186.76	4,517,066,256	1.450000	2029/4/30	33.06

（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 3年 2月26日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	99.34
合計	99.34

（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

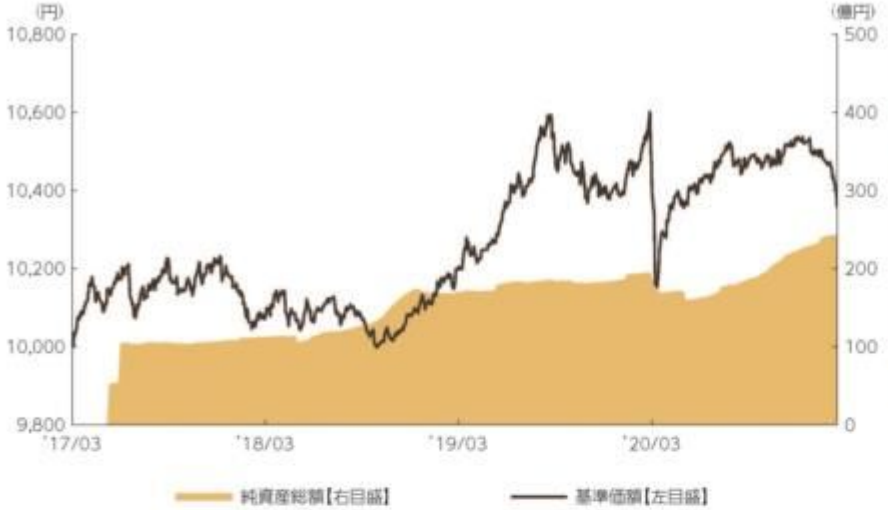
該当事項はありません。

≪参考情報≫

運用実績

2021年2月26日現在

■基準価額・純資産の推移　2017年3月13日(設定日)～2021年2月26日



•基準価額は10,000を起点として表示
•基準価額は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	10,358円
純資産総額	242.4億円

•純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2021 年　2月	0円
2020 年　2月	0円
2019 年　2月	0円
2018 年　2月	0円
設定来累計	0円

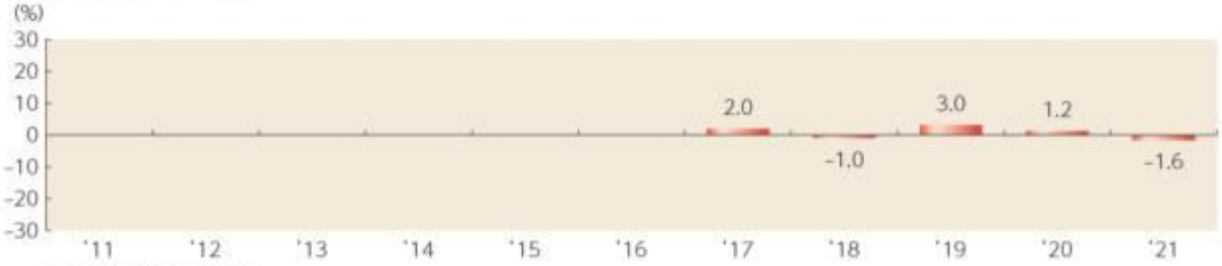
•分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

	組入上位銘柄	比率
1	日本債券インデックスマザーファンド	29.4%
2	ショートデュレーション円インカムマザーファンド	22.4%
3	三菱UFJ　国内債券アクティブマザーファンド	19.6%
4	AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>(FOFs用)(適格機関投資家限定)	10.4%
5	MUAM　ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド	8.3%
6	ヘッジ付スペイン国債7-10年ラダーマザーファンド	3.9%
7	フランス国債7-10年ラダーマザーファンド	1.9%
8	先進国高格付国債マザーファンド	1.9%

•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)

■年間収益率の推移



•収益率は基準価額で計算
•2017年は設定日から年末までの、2021年は年初から2月26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。

第２【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

①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の前営業日
ニューヨークの銀行の休業日の前営業日
ロンドン証券取引所の休業日の前営業日
ロンドンの銀行の休業日の前営業日
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。

②申込単位

販売会社が定める単位

③申込価額

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額

④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。

⑤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いただけます。
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/

⑥申込手数料

ありません。

⑦申込方法

取得申込者は、販売会社に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。
なお、申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があります。申込みコースの取扱いは販売会社により異なる場合があります。

⑧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。

⑨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（投資対象証券の取得の制限等）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。
また、信託金の限度額に達しない場合でも、ファンドの運用規模・運用効率等を勘案し、市況動向や資金流入の動向等に応じて、取得の申込みの受付を中止することがあります。

※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】

①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の前営業日
ニューヨークの銀行の休業日の前営業日
ロンドン証券取引所の休業日の前営業日
ロンドンの銀行の休業日の前営業日
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。

②解約単位
販売会社が定める単位

③解約価額
解約請求受付日の翌々営業日の基準価額

④信託財産留保額
ありません。

⑤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。

⑥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/

⑦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７営業日目から販売会社において支払います。

⑧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。

⑨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（投資対象証券の換金の制限等）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】

①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1万口当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。

②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。

③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】

2027年2月5日まで（2017年3月13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。また、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

（４）【計算期間】

毎年２月６日から翌年２月５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】

①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。

②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。

③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（変更にあっては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、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、これを行使することができます。なお、受益者が議決権を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。

④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。

⑤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。

⑥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。

⑦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。

⑧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。受託会社が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。

⑨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。

⑩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応じて受領する権利を有します。
①分配金受取コース（一般コース）
収益分配金は、税金を差引いた後、毎計算期間の終了日後１ヵ月以内の委託会社の指定する日

（原則として決算日から起算して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、収益分配金について支払開始日から５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。

②分配金再投資コース（累積投資コース）
収益分配金は、税金を差引いた後、「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。

（２）償還金に対する受領権
受益者は、償還金を持ち分に応じ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（令和 2年 2月 6日から令和 3年 2月 5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】

【国内債券セレクション（ラップ向け）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 ［ 令和 2年 2月 5日現在 ］	第4期 ［ 令和 3年 2月 5日現在 ］
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	543,265,394	554,876,162
投資信託受益証券	2,034,393,476	2,529,870,506
親投資信託受益証券	16,778,657,262	21,102,853,256
流動資産合計	19,356,316,132	24,187,599,924
資産合計	19,356,316,132	24,187,599,924
負債の部		
流動負債		
未払解約金	31,751,571	31,993,100
未払受託者報酬	3,043,860	3,432,745
未払委託者報酬	32,467,781	36,615,821
未払利息	187	102
その他未払費用	365,202	411,863
流動負債合計	67,628,601	72,453,631
負債合計	67,628,601	72,453,631
純資産の部		
元本等		
元本	18,454,023,512	23,025,291,012
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	834,664,019	1,089,855,281
（分配準備積立金）	501,179,234	446,338,916
元本等合計	19,288,687,531	24,115,146,293
純資産合計	19,288,687,531	24,115,146,293
負債純資産合計	19,356,316,132	24,187,599,924

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　平成31年 2月 6日 至　令和 2年 2月 5日	第4期 自　令和 2年 2月 6日 至　令和 3年 2月 5日
営業収益		
受取利息	1,793	2,719
有価証券売買等損益	585,349,457	60,643,024
その他収益	26,136	-
営業収益合計	585,377,386	60,645,743
営業費用		
支払利息	201,696	152,236
受託者報酬	5,854,630	6,283,290
委託者報酬	62,449,280	67,021,617
その他費用	703,442	753,871
営業費用合計	69,209,048	74,211,014
営業利益又は営業損失（△）	516,168,338	△13,565,271
経常利益又は経常損失（△）	516,168,338	△13,565,271
当期純利益又は当期純損失（△）	516,168,338	△13,565,271
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（△）	69,977,433	△36,574,137
期首剰余金又は期首欠損金（△）	252,690,605	834,664,019
剰余金増加額又は欠損金減少額	197,060,875	537,176,939
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	197,060,875	537,176,939
剰余金減少額又は欠損金増加額	61,278,366	304,994,543
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	61,278,366	304,994,543
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	834,664,019	1,089,855,281

（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	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。 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3期 [令和 2年 2月 5日現在]	第4期 [令和 3年 2月 5日現在]
１． 期首元本額	16,526,956,262円	18,454,023,512円
期中追加設定元本額	5,442,609,493円	11,312,543,909円
期中一部解約元本額	3,515,542,243円	6,741,276,409円
２． 受益権の総数	18,454,023,512口	23,025,291,012口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第3期
自 平成31年 2月 6日
至 令和 2年 2月 5日

１.運用に係る権限を委託するための費用

「先進国高格付国債マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の12.5以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

２.分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	173,020,245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	184,489,078円
収益調整金額	C	333,484,785円
分配準備積立金額	D	143,669,911円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	834,664,019円
当ファンドの期末残存口数	F	18,454,023,512口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	452円
1万口当たり分配金額	H	一円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	一円

第4期
自 令和 2年 2月 6日
至 令和 3年 2月 5日

１.運用に係る権限を委託するための費用

「先進国高格付国債マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の12.5以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

２.分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	103,612,945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	一円
収益調整金額	C	643,516,365円
分配準備積立金額	D	342,725,971円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,089,855,281円
当ファンドの期末残存口数	F	23,025,291,012口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	473円
1万口当たり分配金額	H	一円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	一円

（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3期 自 平成31年 2月 6日 至 令和 2年 2月 5日	第4期 自 令和 2年 2月 6日 至 令和 3年 2月 5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、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。 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3期 ［令和 2年 2月 5日現在］	第4期 ［令和 3年 2月 5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。	（１）有価証券 同左
	（２）デリバティブ取引	（２）デリバティブ取引

区分	第3期 ［令和 2年 2月 5日現在］	第4期 ［令和 3年 2月 5日現在］
	デリバティブ取引は、該当事項はありません。	同左
	（３）上記以外の金融商品	（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。	同左
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3期 ［令和 2年 2月 5日現在］	第4期 ［令和 3年 2月 5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）
投資信託受益証券	199,860,480	63,990,157
親投資信託受益証券	315,796,543	29,068,967
合計	515,657,023	93,059,124

（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3期 ［令和 2年 2月 5日現在］	第4期 ［令和 3年 2月 5日現在］
1口当たり純資産額	1.0452円	1.0473円
(1万口当たり純資産額)	(10,452円)	(10,473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
投資信託受益証券	ＡＭＰ グローバル・インフラ債券ファンド＜為替ヘッジあり＞（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	2,156,936,232	2,529,870,506	
投資信託受益証券 合計		2,156,936,232	2,529,870,506	
親投資信託受益証券	先進国高格付国債マザーファンド	405,540,169	469,980,501	
	フランス国債７－１０年ラダーマザーファンド	409,686,814	470,607,243	
	ショートデュレーション円インカムマザーファンド	5,550,830,692	5,385,971,020	
	ヘッジ付スペイン国債７－１０年ラダーマザーファンド	862,369,240	943,173,237	
	三菱ＵＦＪ　国内債券アクティブマザーファンド	3,231,831,001	4,733,662,867	
	ＭＵＡＭ　ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド	1,129,040,949	1,999,418,616	
	日本債券インデックスマザーファンド	5,283,553,931	7,100,039,772	
親投資信託受益証券 合計		16,872,852,796	21,102,853,256	
合計		19,029,789,028	23,632,723,762	

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 3年 2月 5日現在］
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,078,682,118
国債証券	271,685,326,280
地方債証券	16,102,985,322
特殊債券	19,616,577,265
社債券	14,740,184,500
未収入金	1,807,283,000
未収利息	644,366,204
前払金	710,000
前払費用	19,542,387
差入委託証拠金	2,160,000
流動資産合計	325,697,817,076
資産合計	325,697,817,076
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	803,300
未払金	2,686,506,000
未払解約金	97,883,960
未払利息	199
流動負債合計	2,785,193,459
負債合計	2,785,193,459
純資産の部	
元本等	
元本	240,296,636,471
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	82,615,987,146
元本等合計	322,912,623,617
純資産合計	322,912,623,617
負債純資産合計	325,697,817,076

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 3年 2月 5日現在]
１．　期首	令和 2年 2月 6日
期首元本額	479,213,833,879円
期中追加設定元本額	237,345,720,336円
期中一部解約元本額	476,262,917,744円
元本の内訳※	
ｅＭＡＸＩＳ　国内債券インデックス	8,941,950,455円
ｅＭＡＸＩＳ　バランス（８資産均等型）	2,756,757,742円
ｅＭＡＸＩＳ　バランス（波乗り型）	73,331,246円
コアバランス	2,424,120円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０３０（確定拠出年金）	1,334,270,011円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０４０（確定拠出年金）	676,934,159円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０５０（確定拠出年金）	277,827,048円
ｅＭＡＸＩＳ　Ｓｌｉｍ　国内債券インデックス	8,812,700,798円
国内債券セレクション（ラップ向け）	5,283,553,931円
ｅＭＡＸＩＳ　Ｓｌｉｍ　バランス（８資産均等型）	6,522,353,157円
つみたて８資産均等バランス	3,028,353,800円
つみたて４資産均等バランス	898,682,185円
ｅＭＡＸＩＳ　マイマネージャー　１９７０ｓ	3,108,042円
ｅＭＡＸＩＳ　マイマネージャー　１９８０ｓ	527,712円
ｅＭＡＸＩＳ　マイマネージャー　１９９０ｓ	66,502円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０３５（確定拠出年金）	544,695,857円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０４５（確定拠出年金）	211,820,079円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０５５（確定拠出年金）	72,117,533円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金）	71,564,608円
国内債券インデックスファンド（ラップ向け）	11,147,226円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０６５（確定拠出年金）	2,121,028円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定型）	206,323,255円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定成長型）	231,423,622円
ｅＭＡＸＩＳ　債券バランス（２資産均等型）	68,764,389円
ｅＭＡＸＩＳ　バランス（４資産均等型）	577,816,945円
ｅＭＡＸＩＳ　最適化バランス（マイゴールキーパー）	850,943,193円
ｅＭＡＸＩＳ　最適化バランス（マイディフェンダー）	472,019,292円
ｅＭＡＸＩＳ　最適化バランス（マイミッドフィルダー）	993,883,832円
ｅＭＡＸＩＳ　最適化バランス（マイフォワード）	124,072,397円
ｅＭＡＸＩＳ　最適化バランス（マイストライカー）	16,851,322円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	67,714,302円

	[令和 3年 2月 5日現在]
三菱ＵＦＪ　バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,225,984,560円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　２０型（適格機関投資家限定）	1,103,938,814円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　４０型（適格機関投資家限定）	4,950,756,728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）	128,821,420,939円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　５０型（適格機関投資家限定）	530,184,627円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,761,668円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　３０型（適格機関投資家限定）	3,843,177円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,989,976,640円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,262,577,967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）	4,721,520,243円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	285,392,401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）	11,684,152,030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）	5,847,525,104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）	3,123,670,205円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２０－０７（適格機関投資家限定）	464,386,656円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	463,972,979円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２０－１１（適格機関投資家限定）	464,110,790円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２１－０１（適格機関投資家限定）	464,145,255円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	16,188,336円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	30,500,292円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	11,478,225円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	7,860,611円
三菱ＵＦＪ　バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	77,852,055円
三菱ＵＦＪ　バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	163,079,657円
三菱ＵＦＪ　バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	52,728,491円
三菱ＵＦＪ　バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	98,231,357円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞日本債券インデックスファンド	4,204,462,614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）	2,133,599,440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）	4,080,228,415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）	2,378,065,683円

	[令和 3年 2月 5日現在]
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス　ファンド（積極型）	1,478,920,724円
合計	240,296,636,471円
２．　受益権の総数	240,296,636,471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 令和 2年 2月 6日 至 令和 3年 2月 5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 3年 2月 5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。

区分	［令和 3年 2月 5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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	［令和 3年 2月 5日現在］
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△3,387,454,030
地方債証券	△83,186,413
特殊債券	△134,616,400
社債券	46,143,000
合計	△3,559,113,843

(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 3年 2月 5日現在］

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	債券先物取引				
	買建	455,720,000	—	454,920,000	△800,000
合計		455,720,000	—	454,920,000	△800,000

（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 3年 2月 5日現在］
1口当たり純資産額	1.3438円
(1万口当たり純資産額)	(13,438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４１５回利付国債（２年）	2,050,000,000	2,057,277,500	
	第４１７回利付国債（２年）	550,000,000	552,172,500	
	第４１８回利付国債（２年）	2,360,000,000	2,370,218,800	
	第４２０回利付国債（２年）	680,000,000	683,100,800	
	第４２１回利付国債（２年）	400,000,000	401,864,000	
	第１３１回利付国債（５年）	2,710,000,000	2,716,775,000	
	第１３２回利付国債（５年）	2,150,000,000	2,156,880,000	
	第１３３回利付国債（５年）	2,300,000,000	2,308,740,000	
	第１３４回利付国債（５年）	4,140,000,000	4,158,133,200	
	第１３６回利付国債（５年）	2,520,000,000	2,534,011,200	
	第１３７回利付国債（５年）	2,300,000,000	2,314,168,000	
	第１３８回利付国債（５年）	2,920,000,000	2,940,118,800	
	第１３９回利付国債（５年）	850,000,000	856,230,500	
	第１４０回利付国債（５年）	2,360,000,000	2,378,313,600	
	第１４１回利付国債（５年）	1,470,000,000	1,482,274,500	
	第１４２回利付国債（５年）	2,420,000,000	2,441,126,600	
	第１４３回利付国債（５年）	2,340,000,000	2,361,738,600	
	第１４４回利付国債（５年）	4,690,000,000	4,735,211,600	
	第１４５回利付国債（５年）	2,380,000,000	2,403,728,600	
	第１４６回利付国債（５年）	710,000,000	717,284,600	
	第１回利付国債（４０年）	225,000,000	325,892,250	
	第２回利付国債（４０年）	470,000,000	660,406,400	
	第３回利付国債（４０年）	433,000,000	611,504,250	
	第４回利付国債（４０年）	598,000,000	849,584,580	
	第５回利付国債（４０年）	635,000,000	873,785,400	
	第６回利付国債（４０年）	530,000,000	719,369,000	

第７回利付国債（４０年）	680,000,000	889,066,000	
第８回利付国債（４０年）	680,000,000	831,674,000	
第９回利付国債（４０年）	1,100,000,000	1,006,995,000	
第１０回利付国債（４０年）	1,160,000,000	1,244,807,600	
第１１回利付国債（４０年）	830,000,000	864,635,900	
第１２回利付国債（４０年）	980,000,000	922,415,200	
第１３回利付国債（４０年）	790,000,000	742,623,700	
第３２１回利付国債（１０年）	1,415,000,000	1,432,687,500	
第３２２回利付国債（１０年）	770,000,000	778,762,600	
第３２３回利付国債（１０年）	975,000,000	988,689,000	
第３２４回利付国債（１０年）	1,600,000,000	1,620,288,000	
第３２５回利付国債（１０年）	2,335,000,000	2,370,095,050	
第３２６回利付国債（１０年）	530,000,000	538,215,000	
第３２７回利付国債（１０年）	1,540,000,000	1,566,734,400	
第３２８回利付国債（１０年）	2,000,000,000	2,030,880,000	
第３２９回利付国債（１０年）	3,160,000,000	3,229,614,800	
第３３０回利付国債（１０年）	1,830,000,000	1,874,633,700	
第３３１回利付国債（１０年）	760,000,000	774,546,400	
第３３２回利付国債（１０年）	1,240,000,000	1,266,188,800	
第３３３回利付国債（１０年）	3,550,000,000	3,630,904,500	
第３３４回利付国債（１０年）	2,830,000,000	2,899,250,100	
第３３５回利付国債（１０年）	2,470,000,000	2,526,019,600	
第３３６回利付国債（１０年）	2,380,000,000	2,437,262,800	
第３３７回利付国債（１０年）	640,000,000	650,432,000	
第３３８回利付国債（１０年）	2,080,000,000	2,124,657,600	
第３３９回利付国債（１０年）	1,960,000,000	2,004,668,400	
第３４０回利付国債（１０年）	1,050,000,000	1,075,074,000	
第３４１回利付国債（１０年）	2,070,000,000	2,112,000,300	
第３４２回利付国債（１０年）	1,890,000,000	1,909,901,700	
第３４３回利付国債（１０年）	2,620,000,000	2,648,243,600	
第３４４回利付国債（１０年）	1,930,000,000	1,951,230,000	
第３４５回利付国債（１０年）	2,350,000,000	2,376,296,500	
第３４６回利付国債（１０年）	2,370,000,000	2,396,923,200	
第３４７回利付国債（１０年）	1,840,000,000	1,861,160,000	
第３４８回利付国債（１０年）	2,380,000,000	2,407,679,400	
第３４９回利付国債（１０年）	1,790,000,000	1,810,978,800	
第３５０回利付国債（１０年）	2,610,000,000	2,639,806,200	
第３５１回利付国債（１０年）	2,660,000,000	2,689,472,800	
第３５２回利付国債（１０年）	1,570,000,000	1,586,783,300	
第３５３回利付国債（１０年）	2,340,000,000	2,363,961,600	
第３５４回利付国債（１０年）	3,250,000,000	3,281,655,000	
第３５５回利付国債（１０年）	1,990,000,000	2,008,308,000	

第３５６回利付国債（１０年）	3,000,000,000	3,025,830,000	
第３５７回利付国債（１０年）	1,840,000,000	1,854,646,400	
第３５８回利付国債（１０年）	2,370,000,000	2,386,139,700	
第３５９回利付国債（１０年）	4,240,000,000	4,265,694,400	
第３６０回利付国債（１０年）	3,340,000,000	3,357,568,400	
第３６１回利付国債（１０年）	800,000,000	803,528,000	
第１回利付国債（３０年）	76,000,000	94,248,360	
第２回利付国債（３０年）	98,000,000	119,029,820	
第３回利付国債（３０年）	117,000,000	141,568,830	
第４回利付国債（３０年）	127,000,000	162,307,270	
第５回利付国債（３０年）	58,000,000	70,605,140	
第６回利付国債（３０年）	169,000,000	210,682,160	
第７回利付国債（３０年）	114,000,000	141,808,020	
第８回利付国債（３０年）	142,000,000	169,428,720	
第９回利付国債（３０年）	116,000,000	133,055,480	
第１０回利付国債（３０年）	135,000,000	150,252,300	
第１１回利付国債（３０年）	137,000,000	162,672,430	
第１２回利付国債（３０年）	120,000,000	148,783,200	
第１３回利付国債（３０年）	205,000,000	252,221,750	
第１４回利付国債（３０年）	393,000,000	504,737,760	
第１５回利付国債（３０年）	246,000,000	320,048,460	
第１６回利付国債（３０年）	202,000,000	263,571,620	
第１７回利付国債（３０年）	227,000,000	294,164,760	
第１８回利付国債（３０年）	327,000,000	420,365,040	
第１９回利付国債（３０年）	303,000,000	390,467,010	
第２０回利付国債（３０年）	395,000,000	521,403,950	
第２１回利付国債（３０年）	279,000,000	361,221,300	
第２２回利付国債（３０年）	470,000,000	623,967,300	
第２３回利付国債（３０年）	54,000,000	71,867,520	
第２４回利付国債（３０年）	311,000,000	414,905,100	
第２５回利付国債（３０年）	442,000,000	577,605,600	
第２６回利付国債（３０年）	584,000,000	773,648,160	
第２７回利付国債（３０年）	60,000,000	80,888,400	
第２８回利付国債（３０年）	611,000,000	827,733,920	
第２９回利付国債（３０年）	50,000,000	67,172,500	
第３０回利付国債（３０年）	996,000,000	1,325,626,200	
第３１回利付国債（３０年）	858,000,000	1,131,427,440	
第３２回利付国債（３０年）	739,000,000	991,782,340	
第３３回利付国債（３０年）	944,000,000	1,219,799,040	
第３４回利付国債（３０年）	1,016,000,000	1,356,380,320	
第３５回利付国債（３０年）	1,119,000,000	1,455,785,430	
第３６回利付国債（３０年）	1,059,000,000	1,382,100,900	

第３７回利付国債（３０年）	1,317,000,000	1,698,166,140	
第３８回利付国債（３０年）	515,000,000	655,461,100	
第３９回利付国債（３０年）	710,000,000	919,158,900	
第４０回利付国債（３０年）	630,000,000	803,735,100	
第４１回利付国債（３０年）	570,000,000	715,475,400	
第４２回利付国債（３０年）	550,000,000	691,014,500	
第４３回利付国債（３０年）	770,000,000	968,344,300	
第４４回利付国債（３０年）	620,000,000	780,425,000	
第４５回利付国債（３０年）	720,000,000	875,361,600	
第４６回利付国債（３０年）	900,000,000	1,094,814,000	
第４７回利付国債（３０年）	880,000,000	1,091,393,600	
第４８回利付国債（３０年）	860,000,000	1,027,381,800	
第４９回利付国債（３０年）	930,000,000	1,111,405,800	
第５０回利付国債（３０年）	820,000,000	865,223,000	
第５１回利付国債（３０年）	980,000,000	917,299,600	
第５２回利付国債（３０年）	820,000,000	805,363,000	
第５３回利付国債（３０年）	870,000,000	873,906,300	
第５４回利付国債（３０年）	580,000,000	609,620,600	
第５５回利付国債（３０年）	860,000,000	903,258,000	
第５６回利付国債（３０年）	780,000,000	818,617,800	
第５７回利付国債（３０年）	770,000,000	807,491,300	
第５８回利付国債（３０年）	1,470,000,000	1,540,339,500	
第５９回利付国債（３０年）	660,000,000	674,718,000	
第６０回利付国債（３０年）	740,000,000	792,584,400	
第６１回利付国債（３０年）	890,000,000	906,910,000	
第６２回利付国債（３０年）	490,000,000	473,653,600	
第６３回利付国債（３０年）	500,000,000	469,500,000	
第６４回利付国債（３０年）	1,100,000,000	1,031,162,000	
第６５回利付国債（３０年）	750,000,000	701,865,000	
第６６回利付国債（３０年）	380,000,000	355,440,600	
第６７回利付国債（３０年）	1,240,000,000	1,223,198,000	
第６８回利付国債（３０年）	750,000,000	739,762,500	
第６９回利付国債（３０年）	280,000,000	283,500,000	
第５５回利付国債（２０年）	241,000,000	246,716,520	
第５６回利付国債（２０年）	349,000,000	359,138,450	
第５８回利付国債（２０年）	147,000,000	151,824,540	
第５９回利付国債（２０年）	489,000,000	505,709,130	
第６１回利付国債（２０年）	289,000,000	295,907,100	
第６３回利付国債（２０年）	342,000,000	357,636,240	
第６４回利付国債（２０年）	341,000,000	359,151,430	
第６５回利付国債（２０年）	218,000,000	230,715,940	
第６６回利付国債（２０年）	400,000,000	422,184,000	

第６８回利付国債（２０年）	646,000,000	692,990,040	
第７０回利付国債（２０年）	222,000,000	240,921,060	
第７１回利付国債（２０年）	160,000,000	172,556,800	
第７２回利付国債（２０年）	434,000,000	469,049,840	
第７３回利付国債（２０年）	320,000,000	346,326,400	
第７４回利付国債（２０年）	318,000,000	345,395,700	
第７５回利付国債（２０年）	475,000,000	518,438,750	
第７６回利付国債（２０年）	200,000,000	216,640,000	
第７７回利付国債（２０年）	110,000,000	119,606,300	
第７８回利付国債（２０年）	310,000,000	337,307,900	
第７９回利付国債（２０年）	50,000,000	54,623,500	
第８０回利付国債（２０年）	215,000,000	235,822,750	
第８１回利付国債（２０年）	250,000,000	274,460,000	
第８２回利付国債（２０年）	462,000,000	509,345,760	
第８３回利付国債（２０年）	213,000,000	236,014,650	
第８４回利付国債（２０年）	470,000,000	518,485,200	
第８５回利付国債（２０年）	290,000,000	322,764,200	
第８６回利付国債（２０年）	515,000,000	578,473,750	
第８７回利付国債（２０年）	250,000,000	279,530,000	
第８８回利付国債（２０年）	804,000,000	907,764,240	
第８９回利付国債（２０年）	210,000,000	235,970,700	
第９０回利付国債（２０年）	800,000,000	903,360,000	
第９１回利付国債（２０年）	468,000,000	531,105,120	
第９２回利付国債（２０年）	832,000,000	939,111,680	
第９３回利付国債（２０年）	190,000,000	214,263,000	
第９４回利付国債（２０年）	615,000,000	697,311,600	
第９５回利付国債（２０年）	817,000,000	941,028,770	
第９６回利付国債（２０年）	220,000,000	250,584,400	
第９７回利付国債（２０年）	243,000,000	279,649,260	
第９８回利付国債（２０年）	270,000,000	308,928,600	
第９９回利付国債（２０年）	845,000,000	971,445,800	
第１００回利付国債（２０年）	660,000,000	766,227,000	
第１０１回利付国債（２０年）	373,000,000	438,357,060	
第１０２回利付国債（２０年）	330,000,000	389,594,700	
第１０３回利付国債（２０年）	440,000,000	516,208,000	
第１０４回利付国債（２０年）	300,000,000	347,529,000	
第１０５回利付国債（２０年）	570,000,000	662,898,600	
第１０６回利付国債（２０年）	411,000,000	481,124,820	
第１０７回利付国債（２０年）	367,000,000	428,439,470	
第１０８回利付国債（２０年）	500,000,000	575,830,000	
第１０９回利付国債（２０年）	500,000,000	577,975,000	
第１１０回利付国債（２０年）	596,000,000	698,631,200	

第１１１回利付国債（２０年）	411,000,000	487,010,340	
第１１２回利付国債（２０年）	840,000,000	988,318,800	
第１１３回利付国債（２０年）	682,000,000	805,360,160	
第１１４回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,208,771,400	
第１１５回利付国債（２０年）	654,000,000	780,823,680	
第１１６回利付国債（２０年）	246,000,000	294,629,280	
第１１７回利付国債（２０年）	1,090,000,000	1,295,563,100	
第１１８回利付国債（２０年）	76,000,000	89,934,600	
第１１９回利付国債（２０年）	160,000,000	186,350,400	
第１２０回利付国債（２０年）	260,000,000	297,967,800	
第１２１回利付国債（２０年）	839,000,000	987,972,840	
第１２２回利付国債（２０年）	100,000,000	116,799,000	
第１２３回利付国債（２０年）	518,000,000	622,216,420	
第１２４回利付国債（２０年）	900,000,000	1,072,242,000	
第１２５回利付国債（２０年）	1,104,000,000	1,341,404,160	
第１２７回利付国債（２０年）	350,000,000	414,711,500	
第１２８回利付国債（２０年）	1,054,000,000	1,251,772,560	
第１３０回利付国債（２０年）	1,262,000,000	1,489,652,180	
第１３１回利付国債（２０年）	290,000,000	339,262,300	
第１３２回利付国債（２０年）	187,000,000	219,270,590	
第１３３回利付国債（２０年）	970,000,000	1,147,820,400	
第１３４回利付国債（２０年）	1,225,000,000	1,453,009,250	
第１３６回利付国債（２０年）	130,000,000	151,342,100	
第１３７回利付国債（２０年）	602,000,000	709,005,500	
第１３８回利付国債（２０年）	350,000,000	404,362,000	
第１３９回利付国債（２０年）	400,000,000	466,616,000	
第１４０回利付国債（２０年）	1,117,000,000	1,318,383,930	
第１４１回利付国債（２０年）	220,000,000	260,198,400	
第１４２回利付国債（２０年）	1,620,000,000	1,934,928,000	
第１４３回利付国債（２０年）	1,060,000,000	1,243,539,000	
第１４４回利付国債（２０年）	230,000,000	267,087,500	
第１４５回利付国債（２０年）	1,600,000,000	1,899,824,000	
第１４６回利付国債（２０年）	1,080,000,000	1,284,843,600	
第１４７回利付国債（２０年）	1,620,000,000	1,910,401,200	
第１４８回利付国債（２０年）	1,230,000,000	1,436,098,800	
第１４９回利付国債（２０年）	1,310,000,000	1,531,625,800	
第１５０回利付国債（２０年）	1,560,000,000	1,805,700,000	
第１５１回利付国債（２０年）	1,590,000,000	1,799,609,700	
第１５２回利付国債（２０年）	1,120,000,000	1,268,467,200	
第１５３回利付国債（２０年）	1,540,000,000	1,766,626,400	
第１５４回利付国債（２０年）	1,110,000,000	1,258,662,300	
第１５５回利付国債（２０年）	1,420,000,000	1,569,242,000	

	第１５６回利付国債（２０年）	900,000,000	914,985,000	
	第１５７回利付国債（２０年）	1,500,000,000	1,477,965,000	
	第１５８回利付国債（２０年）	1,000,000,000	1,029,060,000	
	第１５９回利付国債（２０年）	940,000,000	981,209,600	
	第１６０回利付国債（２０年）	1,270,000,000	1,343,926,700	
	第１６１回利付国債（２０年）	1,250,000,000	1,302,387,500	
	第１６２回利付国債（２０年）	1,560,000,000	1,623,772,800	
	第１６３回利付国債（２０年）	1,230,000,000	1,278,954,000	
	第１６４回利付国債（２０年）	1,300,000,000	1,329,328,000	
	第１６５回利付国債（２０年）	1,300,000,000	1,327,560,000	
	第１６６回利付国債（２０年）	1,980,000,000	2,086,306,200	
	第１６７回利付国債（２０年）	1,120,000,000	1,140,563,200	
	第１６８回利付国債（２０年）	920,000,000	919,218,000	
	第１６９回利付国債（２０年）	890,000,000	871,790,600	
	第１７０回利付国債（２０年）	1,100,000,000	1,076,273,000	
	第１７１回利付国債（２０年）	830,000,000	811,167,300	
	第１７２回利付国債（２０年）	1,220,000,000	1,212,460,400	
	第１７３回利付国債（２０年）	1,310,000,000	1,300,646,600	
	第１７４回利付国債（２０年）	1,500,000,000	1,487,820,000	
	第１７５回利付国債（２０年）	300,000,000	303,009,000	
国債証券 合計		253,431,000,000	271,685,326,280	
地方債証券	第１回東京都公募公債（２０年）	20,000,000	20,725,400	
	第４回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	216,002,000	
	第７回東京都公募公債（３０年）	10,000,000	13,460,800	
	第２０回東京都公募公債（２０年）	80,000,000	93,339,200	
	第２１回東京都公募公債（２０年）	80,000,000	94,370,400	
	第２２回東京都公募公債（２０年）	120,000,000	139,693,200	
	第２８回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	115,889,000	
	第３３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	96,954,000	
	第７１１回東京都公募公債	300,000,000	303,939,000	
	第７１９回東京都公募公債	100,000,000	101,800,000	
	第７２２回東京都公募公債	100,000,000	101,874,000	
	第７２９回東京都公募公債	100,000,000	102,117,000	
	第７６８回東京都公募公債	100,000,000	100,633,000	
	平成２４年度第９回北海道公募公債	100,000,000	101,326,000	
	平成２５年度第７回北海道公募公債	150,000,000	152,980,500	
	平成２８年度第１２回北海道公募公債	100,000,000	100,528,000	
	平成２９年度第１５回北海道公募公債	117,000,000	118,024,920	
	第２９回１号宮城県公募公債	100,000,000	101,821,000	
	第２回神奈川県公募公債（２０年）	80,000,000	86,429,600	
	第２回神奈川県公募公債（３０年）	80,000,000	109,644,000	
	第２７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	114,294,000	

第１９１回神奈川県公募公債	100,000,000	101,122,000	
第１１回大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	117,394,000	
第３４８回大阪府公募公債	10,000,000	10,018,800	
第３５８回大阪府公募公債	56,000,000	56,561,680	
第３５９回大阪府公募公債	56,000,000	56,616,560	
第３７５回大阪府公募公債	100,000,000	102,075,000	
第３７６回大阪府公募公債	106,000,000	108,224,940	
第３７８回大阪府公募公債	300,000,000	305,688,000	
第３８５回大阪府公募公債	200,000,000	204,232,000	
第３８８回大阪府公募公債	200,000,000	203,746,000	
第３９３回大阪府公募公債	110,000,000	111,974,500	
第４１９回大阪府公募公債	300,000,000	301,926,000	
第４２９回大阪府公募公債	103,000,000	103,663,320	
平成２３年度第９回京都府公募公債	140,000,000	141,548,400	
第１回兵庫県公募公債（１５年）	300,000,000	325,935,000	
第２回兵庫県公募公債（３０年）	40,000,000	53,537,200	
第４回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	108,234,000	
第５回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	108,693,000	
第１０回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	118,725,000	
平成２８年度第２回兵庫県公募公債	200,000,000	200,050,000	
平成２８年度第３回兵庫県公募公債	200,000,000	200,052,000	
第１４回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	116,873,000	
平成２５年度第１回静岡県公募公債	100,000,000	101,256,000	
平成２５年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	102,260,000	
平成２５年度第８回静岡県公募公債	130,000,000	132,432,300	
平成２３年度第１３回愛知県公募公債	100,000,000	108,415,000	
平成２４年度第１３回愛知県公募公債	100,000,000	101,384,000	
平成２４年度第１５回愛知県公募公債	250,000,000	253,467,500	
平成３０年度第８回愛知県公募公債	200,000,000	202,100,000	
平成２２年度第８回広島県公募公債	26,650,000	26,696,637	
平成２３年度第７回広島県公募公債	100,000,000	101,114,000	
平成２８年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	100,279,000	
第４回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	227,530,000	
第１６回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	112,121,000	
平成２６年度第８回埼玉県公募公債	100,000,000	101,292,000	
平成１９年度第１回福岡県公募公債（３０年）	70,000,000	94,654,700	
平成２０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	80,000,000	104,575,200	
平成２６年度第８回福岡県公募公債	100,000,000	101,673,000	
平成２６年度第１回福岡県公募公債	100,000,000	102,180,000	
平成２７年度第７回福岡県公募公債	100,000,000	102,216,000	
第９回千葉県公募公債（２０年）	80,000,000	93,000,000	
平成２３年度第９回千葉県公募公債	20,000,000	20,224,000	

平成２４年度第１回千葉県公募公債	20,000,000	20,253,000	
平成２４年度第６回千葉県公募公債	100,000,000	101,442,000	
平成２５年度第１回千葉県公募公債	82,500,000	83,542,800	
平成２５年度第８回千葉県公募公債	100,000,000	101,848,000	
第７回群馬県公募公債（２０年）	100,000,000	98,956,000	
平成２４年度第１回大分県公募公債	100,260,000	101,632,559	
平成２７年度第１回大分県公募公債	203,400,000	207,882,936	
第１１０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,142,000	
第１１４回共同発行市場公募地方債	400,000,000	405,272,000	
第１１７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,332,000	
第１２３回共同発行市場公募地方債	500,000,000	510,235,000	
第１２４回共同発行市場公募地方債	400,000,000	408,880,000	
第１２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,821,000	
第１３０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,226,000	
第１４０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,882,000	
第１４２回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,656,000	
第１４５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,667,000	
第１６２回共同発行市場公募地方債	300,000,000	300,672,000	
第１７８回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,798,000	
平成３０年度第１回福島県公募公債	100,000,000	101,075,000	
平成２５年度第１回栃木県公募公債	100,000,000	101,800,000	
平成２４年度第２回熊本県公募公債	50,000,000	50,679,500	
平成２４年度第１回浜松市公募公債	100,000,000	101,642,000	
平成２５年度第１回浜松市公募公債	161,000,000	164,585,470	
第５回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	117,847,000	
平成２３年度第１０回大阪市公募公債	10,000,000	10,092,200	
第１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	130,115,000	
第１０回名古屋市公募公債（２０年）	80,000,000	94,380,800	
第５回京都市公募公債（２０年）	50,000,000	56,705,000	
平成２４年度第４回京都市公募公債	100,000,000	101,350,000	
平成２０年度第２４回神戸市公募公債（２０年）	300,000,000	345,855,000	
平成２２年度第４回神戸市公募公債	100,000,000	116,688,000	
第７回横浜市公募公債（２０年）	200,000,000	219,954,000	
第２０回横浜市公募公債（２０年）	80,000,000	93,499,200	
平成２４年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	101,365,000	
平成２４年度第３回横浜市公募公債	100,000,000	101,349,000	
平成２７年度第２回横浜市公募公債	200,000,000	204,854,000	
平成２７年度第３回横浜市公募公債	500,000,000	511,630,000	
第２７回横浜市公募公債（２０年）	60,000,000	69,646,800	
第３３回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	99,179,000	
第３５回横浜市公募公債（２０年）	300,000,000	301,908,000	
平成２２年度第８回札幌市公募公債（３０年）	80,000,000	106,248,800	

	平成２３年度第３回札幌市公募公債	100,000,000	118,078,000	
	平成２４年度第１０回札幌市公募公債	100,000,000	101,478,000	
	第１７回北九州市公募公債（２０年）	100,000,000	115,798,000	
	平成２５年度第３回北九州市公募公債	100,000,000	102,028,000	
	平成２４年度第４回福岡市公募公債	200,000,000	202,738,000	
	平成２５年度第４回福岡市公募公債	50,000,000	50,909,500	
	平成２５年度第２回広島市公募公債	100,000,000	102,051,000	
	平成２６年度第４回福井県公募公債	100,000,000	101,746,000	
	平成３０年度第１回山梨県公募公債	100,000,000	101,294,000	
	平成２８年度第１回岡山県公募公債	300,000,000	302,055,000	
	第４回京都市保証京都市土地開発公社債券	200,000,000	199,614,000	
	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	116,001,000	
地方債証券 合計		15,341,810,000	16,102,985,322	
特殊債券	第２２回政府保証日本政策投資銀行	20,000,000	20,394,400	
	第１７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	112,692,000	
	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	44,984,700	
	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	147,365,000	
	第２３回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	300,000,000	343,935,000	
	第２７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	229,762,000	
	第３３回道路債券（財投機関債）	300,000,000	400,134,000	
	第７０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,504,000	
	第８３回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	150,000,000	176,956,500	
	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	133,171,000	
	第１４５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	117,674,000	
	第１４８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,183,000	
	第１５０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	110,237,000	
	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	131,109,000	
	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	214,058,520	
	第１５９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	119,000,000	120,209,040	
	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	112,444,000	
	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	117,074,000	

第１６５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	125,623,000	
第１６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	659,000,000	667,369,300	
第１６８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	191,000,000	193,406,600	
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	436,007,100	
第１８２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	306,074,860	
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	173,088,093	
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	154,825,290	
第１９５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	323,000,000	330,273,960	
第２００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	308,000,000	314,492,640	
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	126,550,680	
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	114,583,000	
第２３１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	183,000,000	186,383,670	
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	99,887,000	
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	100,743,000	
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	58,770,000	
第３回公営企業債券（２０年）（財投機関債）	20,000,000	20,428,600	
第６回公営企業債券（２０年）（財投機関債）	100,000,000	105,768,000	
第８回地方公共団体金融機構債券（２０年）（財投機関債）	100,000,000	117,263,000	
第９回公営企業債券（２０年）（財投機関債）	50,000,000	54,193,000	
第１１回地方公共団体金融機構債券（２０年）（財投機関債）	100,000,000	115,997,000	
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	95,927,200	
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	93,471,200	
第１７回公営企業債券（２０年）（財投機関債）	150,000,000	167,826,000	
第１８回政府保証地方公共団体金融機構債券（６年）	300,000,000	300,060,000	
第２２回政府保証地方公共団体金融機構債券	30,000,000	30,037,800	
第２３回地方公共団体金融機構債券（２０年）（財投機関債）	100,000,000	115,885,000	
Ｆ２４回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	70,000,000	72,451,400	
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	58,857,000	
第３９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,242,000	

第４１回政府保証地方公共団体金融機構債券	352,000,000	356,815,360	
第４３回政府保証地方公共団体金融機構債券	400,000,000	405,572,000	
第４４回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	102,676,600	
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	112,603,000	
第４５回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,647,000	
第４６回政府保証地方公共団体金融機構債券	17,000,000	17,237,830	
第４８回政府保証地方公共団体金融機構債券	36,000,000	36,491,400	
第５５回政府保証地方公共団体金融機構債券	160,000,000	163,155,200	
第５９回政府保証地方公共団体金融機構債券	315,000,000	321,602,400	
第６１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,125,000	
第６２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,033,000	
第６４回政府保証地方公共団体金融機構債券	240,000,000	244,615,200	
Ｆ６７回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	300,000,000	332,175,000	
第７３回政府保証地方公共団体金融機構債券	302,000,000	308,212,140	
第７８回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	152,661,000	
第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	174,000,000	174,043,500	
Ｆ８９回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	200,000,000	219,512,000	
Ｆ９０回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	110,382,000	
Ｆ１０４回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	105,256,000	
第１０６回政府保証地方公共団体金融機構債券	116,000,000	116,779,520	
Ｆ１２３回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	112,838,000	
Ｆ２３４回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	116,844,000	
第１０回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	94,300,800	
第１５回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	93,216,000	
第２５回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,663,000	
第１７回政府保証民間都市開発債券	100,000,000	100,656,000	
第４８回福祉医療機構債券（財投機関債）	400,000,000	402,100,000	
第５４回福祉医療機構債券（財投機関債）	200,000,000	201,386,000	
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,022,000	12,360,299	
第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,470,000	12,838,987	
第２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,441,000	13,920,171	
第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,741,000	13,162,090	
第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	61,950,000	61,915,927	
第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	66,110,000	66,117,272	
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,542,000	12,912,741	
第４回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	79,641,000	79,436,322	
第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	10,930,000	11,047,278	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	11,362,000	11,582,536	
第６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,511,000	12,846,920	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,308,000	13,776,441	

第７回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	11,377,000	11,592,594	
第８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,218,000	13,621,149	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	11,958,000	12,265,440	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	14,285,000	14,992,964	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	12,408,000	12,762,744	
第１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,958,000	14,529,859	
第１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	9,930,000	9,952,640	
第１６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,383,000	12,527,385	
第１７回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,432,000	12,588,145	
第１９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,854,000	10,993,039	
第２０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,954,000	11,128,716	
第３０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,792,000	10,891,718	
第３２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,722,000	13,025,801	
第３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,688,000	27,411,407	
第３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,808,000	27,453,776	
第３７回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,927,000	13,331,873	
第３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,668,000	29,213,534	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,299,000	12,604,630	
第４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,732,000	29,002,125	
第４１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,378,000	13,876,731	
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,112,000	12,482,021	
第４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,456,000	35,473,396	
第４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,899,000	35,059,806	
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,118,000	29,793,551	
第４７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,292,000	27,941,034	
第４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,262,000	28,863,097	
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,010,000	29,605,449	
第５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,285,000	12,650,847	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,270,000	32,019,303	
第５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,963,000	34,807,609	
第５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,345,000	36,270,380	
第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,136,000	40,260,556	
第５９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,485,000	41,774,735	
第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,993,000	43,207,441	
第６２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,335,000	44,359,459	
第６３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,288,000	44,130,488	
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,017,000	41,981,434	
第７４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,002,000	47,462,259	
第７６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,927,000	40,753,454	
第７７回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	30,000,000	32,687,700	
第７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,758,000	42,451,902	
第８１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,742,000	46,656,062	

第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,866,000	96,623,358	
第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,810,000	99,752,581	
第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,502,000	53,459,591	
第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,735,000	54,527,462	
第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,315,000	56,828,971	
第９５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,565,000	69,712,215	
第９８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,836,000	69,288,881	
第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	134,546,000	139,339,873	
第１０２回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	108,216,000	
第１０３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,028,000	72,490,184	
第１０９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,576,000	78,981,452	
第１１１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	240,735,000	239,396,513	
第１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	414,355,000	419,256,819	
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	170,956,500	
第１２２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,186,000	170,837,255	
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	117,372,000	
第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,350,000	86,044,749	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,048,000	86,737,244	
第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,307,000	88,222,850	
第１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,210,000	87,919,017	
第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,286,000	88,979,927	
第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,754,000	179,737,147	
第１３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,870,000	90,732,752	
第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,196,000	91,252,195	
第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,564,000	91,816,500	
第１４３回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	108,060,000	
第１４７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,762,000	92,950,021	
第１５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,110,000	188,334,372	
第１５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,954,000	190,996,149	
第１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,930,000	99,230,747	
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	198,460,800	
第６回沖縄振興開発金融公庫債券（財投機関債）	50,000,000	54,359,500	
い第８０６号商工債券	200,000,000	200,190,000	
い第８１４号商工債券	200,000,000	200,554,000	
い第８３２号商工債券	100,000,000	99,963,000	
い第８１８号農林債券	200,000,000	200,200,000	
第３３８回信金中金債	200,000,000	200,296,000	
第１１号商工債券（１０年）	100,000,000	102,131,000	
第２３０号商工債券（３年）	100,000,000	100,061,000	

	第２３１号商工債券（３年）	100,000,000	100,054,000	
	第２３６号商工債券（３年）	200,000,000	199,950,000	
	第２回信金中金債（１０年）	100,000,000	102,198,000	
	第７回国際協力機構債券（財投機関債）	70,000,000	82,671,400	
	第３３回中日本高速道路	50,000,000	50,329,500	
	第２９回西日本高速道路	200,000,000	202,298,000	
	第７２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	106,461,000	
特殊債券 合計		18,567,590,000	19,616,577,265	
社債券	第１４回フランス相互信用連合銀行	200,000,000	200,382,000	
	第１９回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	102,969,000	
	第２９回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	99,614,000	
	第８回新韓銀行	100,000,000	100,032,000	
	第１７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	200,000,000	199,872,000	
	第１７回ナショナル・オーストラリア銀行	100,000,000	100,265,000	
	第３回コカ・コーラウエスト	100,000,000	100,511,000	
	第１３回日本たばこ産業	200,000,000	200,516,000	
	第６回ヒューリック	200,000,000	200,174,000	
	第９回クラレ	100,000,000	100,329,000	
	第４回野村総合研究所	100,000,000	100,230,000	
	第２回大塚ホールディングス	100,000,000	100,024,000	
	第６回ヤフー	100,000,000	99,274,000	
	第１５回Ｚホールディングス	400,000,000	399,820,000	
	第１１回ブリヂストン	100,000,000	100,176,000	
	第１３回ブリヂストン	200,000,000	200,408,000	
	第４回新日本製鐵	100,000,000	99,808,000	
	第５１回日本精工	100,000,000	98,960,000	
	第１９回日立製作所	100,000,000	99,221,000	
	第５３回日本電気	100,000,000	100,027,000	
	第５６回日本電気	100,000,000	100,088,000	
	第１７回パナソニック	100,000,000	101,243,000	
	第１８回デンソー	300,000,000	299,475,000	
	第１回日本生命２０１７基金	100,000,000	100,067,000	
	第９回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	200,000,000	199,820,000	
	第６４回日産自動車	100,000,000	100,071,000	
	第３０回いすゞ自動車	200,000,000	200,000,000	
	第１回明治安田生命２０１８基金	100,000,000	100,172,000	
	第１回明治安田生命２０１９基金	100,000,000	100,039,000	
	第８３回クレディセゾン	300,000,000	299,850,000	
	第３回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	200,000,000	202,128,000	
	第１７回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	200,000,000	199,198,000	
	第２６回三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付	100,000,000	107,000,000	

第２９回三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付	200,000,000	216,474,000	
第３０回三菱東京ＵＦＪ銀行（劣後特約付）	100,000,000	116,273,000	
第５７回三菱東京ＵＦＪ銀行	100,000,000	103,700,000	
第４回みずほリース	100,000,000	100,049,000	
第１６回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	100,000,000	100,364,000	
第１７回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	100,000,000	100,700,000	
第４７回日産フィナンシャルサービス	200,000,000	195,434,000	
第２９回東京センチュリー	100,000,000	99,951,000	
第６４回ホンダファイナンス	300,000,000	299,700,000	
第６５回ホンダファイナンス	200,000,000	200,282,000	
第３１回リコーリース	100,000,000	100,322,000	
第３５回リコーリース	100,000,000	99,903,000	
第３９回リコーリース	400,000,000	399,036,000	
第７回イオンフィナンシャルサービス	100,000,000	99,854,000	
第７９回アコム	200,000,000	198,738,000	
第４７回日立キャピタル	100,000,000	101,616,000	
第７０回日立キャピタル	200,000,000	200,378,000	
第８５回日立キャピタル	100,000,000	100,002,000	
第８７回日立キャピタル	300,000,000	300,096,000	
第２１回三井住友ファイナンス＆リース	200,000,000	200,452,000	
第３０回三井住友ファイナンス＆リース	200,000,000	199,528,000	
第２７回野村ホールディングス	100,000,000	107,915,000	
第５０回野村ホールディングス	100,000,000	100,048,000	
第１２回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	100,000,000	101,956,000	
第１２回森トラスト総合リート投資法人	100,000,000	99,344,000	
第３６回京王電鉄	100,000,000	100,706,000	
第１００回東日本旅客鉄道	100,000,000	124,871,000	
第１１回東海旅客鉄道	100,000,000	102,085,000	
第１７回東海旅客鉄道	200,000,000	215,462,000	
第５３回東海旅客鉄道	100,000,000	114,754,000	
第５０回阪急阪神ホールディングス	100,000,000	100,542,000	
第２７回ＫＤＤＩ	100,000,000	99,844,000	
第５回ソフトバンク	600,000,000	599,640,000	
第２９回光通信	100,000,000	100,122,000	
第５６７回東京電力	100,000,000	108,574,000	
第４９９回中部電力	50,000,000	51,335,500	
第５００回中部電力	300,000,000	307,788,000	
第５０８回関西電力	200,000,000	202,608,000	
第５１０回関西電力	300,000,000	304,479,000	
第５１８回関西電力	100,000,000	100,972,000	
第５３２回関西電力	100,000,000	100,224,000	
第５３７回関西電力	100,000,000	99,926,000	

	第３８１回中国電力	100,000,000	102,767,000	
	第３８５回中国電力	100,000,000	102,652,000	
	第４０９回中国電力	200,000,000	202,094,000	
	第３０４回北陸電力	100,000,000	102,452,000	
	第３０７回北陸電力	100,000,000	104,721,000	
	第３２２回北陸電力	100,000,000	101,070,000	
	第４７５回東北電力	300,000,000	307,647,000	
	第５０９回東北電力	100,000,000	100,344,000	
	第４２７回九州電力	100,000,000	103,035,000	
	第４４９回九州電力	100,000,000	101,275,000	
	第４８４回九州電力	200,000,000	201,004,000	
	第３９回電源開発	100,000,000	102,532,000	
	第５７回電源開発	100,000,000	100,568,000	
	第６回東京電力パワーグリッド	100,000,000	102,053,000	
	第１３回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101,299,000	
	第２８回東京電力パワーグリッド	200,000,000	205,218,000	
	第３１回東京電力パワーグリッド	200,000,000	204,536,000	
	第３３回東京電力パワーグリッド	200,000,000	202,312,000	
	第３８回東京電力パワーグリッド	200,000,000	202,154,000	
	第４１回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101,075,000	
	第１３回広島ガス	100,000,000	100,502,000	
	第７回ファーストリテイリング	100,000,000	101,064,000	
社債券 合計		14,550,000,000	14,740,184,500	
合計		301,890,400,000	322,145,073,367	

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。

先進国高格付国債マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

［令和 3年 2月 5日現在］

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,848,735,666
国債証券	94,667,307,007
派生商品評価勘定	91,839,603
未収利息	606,496,130

	［令和 3年 2月 5日現在］
前払費用	30,451,778
流動資産合計	99,244,830,184
資産合計	99,244,830,184
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,241,391,057
未払解約金	6,700,000
未払利息	711
流動負債合計	2,248,091,768
負債合計	2,248,091,768
純資産の部	
元本等	
元本	83,694,364,368
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	13,302,374,048
元本等合計	96,996,738,416
純資産合計	96,996,738,416
負債純資産合計	99,244,830,184

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 3年 2月 5日現在]
１． 期首	令和 2年 2月 6日
期首元本額	119,072,156,430円
期中追加設定元本額	10,242,179,089円
期中一部解約元本額	45,619,971,151円
元本の内訳※	
国内債券セレクション（ラップ向け）	405,540,169円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定型）	17,020,106円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定成長型）	18,569,426円
先進国高格付国債ファンド（ラップ向け）	1,077,198,600円
ＭＵＡＭ　先進国高格付国債ファンド（適格機関投資家転売制限付）	37,811,256,979円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１６－０５（適格機関投資家転売制限付）	520,657,035円

	[令和 3年 2月 5日現在]
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１６－０９（適格機関投資家転売制限付）	1,892,487,101円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１６－１０（適格機関投資家転売制限付）	2,752,942,371円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１６－１１（適格機関投資家転売制限付）	968,267,937円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１６－１２（適格機関投資家転売制限付）	2,354,685,645円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１７－０３（適格機関投資家転売制限付）	1,149,005,729円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１７－０５（適格機関投資家転売制限付）	5,939,878,066円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１７－０７（適格機関投資家転売制限付）	2,947,909,424円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１７－０９（適格機関投資家転売制限付）	2,641,353,432円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１７－１１（適格機関投資家転売制限付）	4,417,782,109円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１８－０１（適格機関投資家転売制限付）	4,760,943,024円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１８－０３（適格機関投資家転売制限付）	3,963,645,378円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１８－０６（適格機関投資家転売制限付）	2,306,856,753円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１８－０７（適格機関投資家転売制限付）	572,370,742円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１８－０９（適格機関投資家転売制限付）	4,169,354,961円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１８－１０（適格機関投資家転売制限付）	1,163,474,026円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１８－１１（適格機関投資家転売制限付）	445,034,656円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１８－１２（適格機関投資家転売制限付）	353,154,651円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１９－０３（適格機関投資家転売制限付）	1,044,976,048円
合計	83,694,364,368円
２．　受益権の総数	83,694,364,368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 令和 2年 2月 6日 至 令和 3年 2月 5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。 当ファンドは、ファンドの運用の指図に関する権限を再委託しております。この場合、再委託先で投資リスクに対する管理体制を構築しているほか、当該再委託先のリスクの管理体制や管理状況の確認を委託会社で行っております。

２　金融商品の時価等に関する事項

区分	［令和 3年 2月 5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 3年 2月 5日現在］
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△1,273,025,423
合計	△1,273,025,423

(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 3年 2月 5日現在］

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	カナダドル	475,077,534	—	486,426,500	11,348,966
	オーストラリアドル	1,895,049,016	—	1,944,683,690	49,634,674
	シンガポールドル	592,587,687	—	601,460,000	8,872,313
	ノルウェークローネ	704,996,370	—	726,980,020	21,983,650
	売建				
	カナダドル	19,188,498,851	—	19,472,852,000	△284,353,149
	オーストラリアドル	38,738,991,195	—	39,916,161,980	△1,177,170,785
	シンガポールドル	19,423,179,514	—	19,688,763,520	△265,584,006
	ノルウェークローネ	19,301,436,703	—	19,815,719,820	△514,283,117
合計		100,319,816,870	—	102,653,047,530	△2,149,551,454

（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。

①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。

②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 3年 2月 5日現在］
1口当たり純資産額	1.1589円
(1万口当たり純資産額)	(11,589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
カナダドル	国債証券	1.25 CAN GOVT 300601	144,000,000.00	148,841,280.00	
		2.25 CAN GOVT 290601	74,000,000.00	82,823,020.00	
カナダドル合計			218,000,000.00	231,664,300.00 (19,063,655,247)	
オーストラリアドル	国債証券	2.25 AUST GOVT 280521	3,000,000.00	3,302,960.40	
		2.5 AUST GOVT 300521	83,000,000.00	93,221,806.90	
		3.25 AUST GOVT 290421	116,000,000.00	137,022,854.00	
		4.25 AUST GOVT 260421	59,000,000.00	70,561,828.80	
		4.75 AUST GOVT 270421	132,000,000.00	165,141,121.20	
オーストラリアドル合計			393,000,000.00	469,250,571.30 (37,629,203,312)	
シンガポールドル	国債証券	2.625 SINGAPORGOV 280501	59,000,000.00	66,127,613.00	
		2.875 SINGAPORGOV 290701	153,000,000.00	175,973,730.30	
シンガポールドル合計			212,000,000.00	242,101,343.30 (19,111,480,040)	
ノルウェークローネ	国債証券	1.75 NORWE GOVT 290906	867,000,000.00	914,364,210.00	
		2 NORWE GOVT 280426	586,000,000.00	627,988,072.00	
ノルウェークローネ合計			1,453,000,000.00	1,542,352,282.00 (18,862,968,408)	

合計		94,667,307,007 (94,667,307,007)	

(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
カナダドル	国債証券	2銘柄	100.00%	20.14%
オーストラリアドル	国債証券	5銘柄	100.00%	39.75%
シンガポールドル	国債証券	2銘柄	100.00%	20.19%
ノルウェークローネ	国債証券	2銘柄	100.00%	19.93%

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。

ＭＵＡＭ　ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	［令和 3年 2月 5日現在］
資産の部	
流動資産	
預金	1,087,431,329
コール・ローン	3,903,626,061
国債証券	172,058,292,775
派生商品評価勘定	154,536,126
未収入金	19,031,107,518
未収利息	506,974,470
前払費用	74,145,049
流動資産合計	196,816,113,328
資産合計	196,816,113,328
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	409,977,150
未払金	20,330,839,524
未払解約金	76,020,481
未払利息	721
流動負債合計	20,816,837,876
負債合計	20,816,837,876
純資産の部	

	［令和 3年 2月 5日現在］
元本等	
元本	99,382,959,964
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	76,616,315,488
元本等合計	175,999,275,452
純資産合計	175,999,275,452
負債純資産合計	196,816,113,328

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 3年 2月 5日現在]
１． 期首	令和 2年 2月 6日
期首元本額	107,737,103,917円
期中追加設定元本額	18,213,513,189円
期中一部解約元本額	26,567,657,142円
元本の内訳※	
国内債券セレクション（ラップ向け）	1,129,040,949円
三菱ＵＦＪ　ヘッジ付外国債券オープン	53,056,952,025円
ＭＵＡＭ　ヘッジ付外国債券オープンⅡ（適格機関投資家限定）	6,654,748,259円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	22,994,197,095円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　２０型（適格機関投資家限定）	832,930,174円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　４０型（適格機関投資家限定）	1,873,984,343円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　５０型（適格機関投資家限定）	807,807,066円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　３０型（適格機関投資家限定）	8,930,492円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	414,571,096円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	46,190,362円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	51,992,089円
三菱ＵＦＪ国際　ヘッジ付外国債券オープン（適格機関投資家限定）	11,511,616,014円

	[令和 3年 2月 5日現在]
合計	99,382,959,964円
２．　受益権の総数	99,382,959,964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 令和 2年 2月 6日 至 令和 3年 2月 5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 3年 2月 5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

区分	［令和 3年 2月 5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	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。 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 3年 2月 5日現在］
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△929,458,829
合計	△929,458,829

(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 3年 2月 5日現在］

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカドル	71,788,348,375	—	72,135,625,000	△347,276,625
	イギリスポンド	10,469,820,475	—	10,532,521,000	△62,700,525
	スウェーデンクローネ	8,024,724,974	—	8,000,428,800	24,296,174
	ポーランドズロチ	1,275,799,561	—	1,268,031,400	7,768,161
	ユーロ	81,129,152,991	—	81,006,681,200	122,471,791
合計		172,687,846,376	—	172,943,287,400	△255,441,024

（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。

①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。

②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 3年 2月 5日現在］
1口当たり純資産額	1.7709円
(1万口当たり純資産額)	(17,709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	0.125 T-NOTE 230915	40,900,000.00	40,866,449.18	
		0.125 T-NOTE 231215	200,000.00	199,695.31	
		0.25 T-NOTE 230615	46,000,000.00	46,120,390.60	
		0.25 T-NOTE 250630	56,700,000.00	56,407,640.62	
		0.5 T-NOTE 270531	35,100,000.00	34,680,445.30	
		0.625 T-NOTE 300515	27,500,000.00	26,359,179.68	
		1.125 T-NOTE 220228	5,300,000.00	5,358,589.84	
		1.25 T-BOND 500515	29,600,000.00	25,058,250.00	
		1.375 T-BOND 401115	63,600,000.00	59,729,343.75	
		1.375 T-NOTE 230215	59,700,000.00	61,208,824.18	
		1.375 T-NOTE 250131	61,600,000.00	64,193,937.50	
		1.5 T-NOTE 270131	43,600,000.00	45,837,906.25	
		1.625 T-NOTE 260515	1,600,000.00	1,693,125.00	
		1.75 T-NOTE 220715	71,300,000.00	72,985,019.49	
		2.125 T-NOTE 250515	14,300,000.00	15,380,320.31	
		2.25 T-NOTE 231231	45,100,000.00	47,806,000.00	
		2.625 T-NOTE 260131	7,800,000.00	8,634,234.37	
		3 T-BOND 441115	19,900,000.00	24,417,921.87	

		3.125 T-NOTE 281115	27,200,000.00	31,739,000.00	
		4.25 T-BOND 401115	7,300,000.00	10,492,609.37	
アメリカドル合計			664,300,000.00	679,168,882.62 (71,679,483,871)	
イギリスポンド	国債証券	0.125 GILT 230131	5,300,000.00	5,312,196.36	
		0.125 GILT 280131	2,800,000.00	2,773,517.60	
		0.375 GILT 301022	5,800,000.00	5,757,835.96	
		0.625 GILT 250607	3,800,000.00	3,893,947.40	
		0.625 GILT 501022	6,900,000.00	6,210,276.00	
		1 GILT 240422	3,800,000.00	3,922,366.84	
		1.25 GILT 411022	25,100,000.00	26,508,652.16	
		1.5 GILT 260722	2,200,000.00	2,365,901.12	
		1.75 GILT 220907	3,800,000.00	3,907,714.80	
		4.25 GILT 491207	3,700,000.00	6,710,527.20	
		6 GILT 281207	3,600,000.00	5,185,064.16	
イギリスポンド合計			66,800,000.00	72,547,999.60 (10,477,382,102)	
スウェーデンクローネ	国債証券	0.125 SWD GOVT 310512	269,700,000.00	269,035,782.84	
		1.5 SWD GOVT 231113	357,700,000.00	376,196,380.84	
スウェーデンクローネ合計			627,400,000.00	645,232,163.68 (8,052,497,402)	
ポーランドズロチ	国債証券	0.75 POLAND 250425	44,700,000.00	45,369,798.21	
ポーランドズロチ合計			44,700,000.00	45,369,798.21 (1,273,076,537)	
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 240715	30,800,000.00	31,493,924.00	
		0 AUSTRIA GOVT 300220	7,300,000.00	7,521,993.00	
		0 BUND 271115	11,300,000.00	11,794,420.20	
		0 BUND 300215	15,800,000.00	16,557,278.20	
		0 BUND 350515	6,700,000.00	6,966,251.30	
		0 FINNISH GOVT 300915	3,600,000.00	3,709,335.60	
		0 IRISH GOVT 221018	4,300,000.00	4,347,704.20	
		0 O.A.T 230325	11,200,000.00	11,362,769.60	
		0 O.A.T 250325	13,300,000.00	13,641,207.51	
		0 O.A.T 260225	8,100,000.00	8,332,640.91	
		0 O.A.T 291125	11,800,000.00	12,131,049.00	
		0 O.A.T 301125	8,900,000.00	9,109,328.00	
		0 SCHATS 221215	11,200,000.00	11,348,064.00	
		0 SPAIN GOVT 250131	19,100,000.00	19,411,864.80	
		0.1 BEL GOVT 300622	6,600,000.00	6,847,439.94	
		0.25 BUND 270215	19,500,000.00	20,616,550.50	
		0.4 SPAIN GOVT 220430	13,700,000.00	13,860,838.00	
		0.5 BUND 250215	18,800,000.00	19,748,629.20	

		0.5 NETH GOVT 260715	21,500,000.00	22,844,115.50	
		0.5 O.A.T 400525	24,000,000.00	25,205,400.00	
		0.5 SPAIN GOVT 300430	10,300,000.00	10,710,362.30	
		0.6 ITALY GOVT 230615	70,800,000.00	72,439,423.56	
		1.1 IRISH GOVT 290515	7,000,000.00	7,837,928.00	
		1.2 SPAIN GOVT 401031	14,100,000.00	15,295,169.58	
		1.3 SPAIN GOVT 261031	28,700,000.00	31,349,440.50	
		1.6 BEL GOVT 470622	5,300,000.00	6,818,569.78	
		1.6 ITALY GOVT 260601	9,200,000.00	9,980,120.44	
		1.7 BEL GOVT 500622	4,400,000.00	5,853,577.84	
		1.85 ITALY GOVT 250701	15,400,000.00	16,717,932.00	
		1.85 SPAIN GOVT 350730	5,700,000.00	6,809,391.00	
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	700,000.00	1,421,445.20	
		2.25 BEL GOVT 230622	1,300,000.00	1,391,709.80	
		2.625 FINNISH GOV 420704	2,400,000.00	3,719,367.60	
		2.75 NETH GOVT 470115	3,300,000.00	5,685,045.30	
		2.8 ITALY GOVT 281201	14,700,000.00	17,519,504.10	
		3.1 ITALY GOVT 400301	9,000,000.00	11,995,236.00	
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	900,000.00	1,534,207.95	
		3.4 IRISH GOVT 240318	10,400,000.00	11,714,607.84	
		4.5 O.A.T 410425	19,400,000.00	35,949,170.00	
		4.7 SPAIN GOVT 410730	10,700,000.00	18,797,385.50	
		5 ITALY GOVT 390801	20,100,000.00	33,263,188.50	
		5.25 ITALY GOVT 291101	3,800,000.00	5,382,697.72	
		5.5 BUND 310104	17,900,000.00	28,885,122.60	
ユーロ合計			553,000,000.00	637,921,406.57 (80,575,852,863)	
合計				172,058,292,775 (172,058,292,775)	

(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	20銘柄	100.00%	41.66%
イギリスポンド	国債証券	11銘柄	100.00%	6.09%
スウェーデンクローネ	国債証券	2銘柄	100.00%	4.68%
ポーランドズロチ	国債証券	1銘柄	100.00%	0.74%
ユーロ	国債証券	43銘柄	100.00%	46.83%

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。

ショートデュレーション円インカムマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	［令和 3年 2月 5日現在］
資産の部	
流動資産	
預金	93,842,133
コール・ローン	2,161,747,303
国債証券	872,915,313
地方債証券	88,770,337
特殊債券	867,208,064
社債券	2,800,635,068
派生商品評価勘定	14,257,838
未収利息	24,469,723
前払費用	5,749,216
差入委託証拠金	157,554,092
流動資産合計	7,087,149,087
資産合計	7,087,149,087
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,565,680
未払解約金	4,899,301
未払利息	399
流動負債合計	27,465,380
負債合計	27,465,380
純資産の部	
元本等	
元本	7,275,464,134
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△215,780,427
元本等合計	7,059,683,707
純資産合計	7,059,683,707
負債純資産合計	7,087,149,087

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。 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 3年 2月 5日現在]
１． 期首	令和 2年 2月 6日
期首元本額	6,476,605,896円
期中追加設定元本額	4,537,470,841円
期中一部解約元本額	3,738,612,603円
元本の内訳※	
国内債券セレクション（ラップ向け）	5,550,830,692円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定型）	220,197,056円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定成長型）	243,090,633円
ショートデュレーション円インカムオープン（ラップ向け）	1,261,345,753円
合計	7,275,464,134円
２． 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	215,780,427円
３． 受益権の総数	7,275,464,134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 令和 2年 2月 6日 至 令和 3年 2月 5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。

区分	自 令和 2年 2月 6日 至 令和 3年 2月 5日
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、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。 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 3年 2月 5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 3年 2月 5日現在］
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△2,427,147
地方債証券	△489,626
特殊債券	△5,700,127
社債券	37,972,720
合計	29,355,820

(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 3年 2月 5日現在］

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	債券先物取引				
	売建	1,031,300,695	—	1,023,791,245	7,509,450
合計		1,031,300,695	—	1,023,791,245	7,509,450

（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はありません。

通貨関連

［令和 3年 2月 5日現在］

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカドル	810,002,252	—	820,401,000	△10,398,748
	カナダドル	575,939,268	—	580,543,800	△4,604,532
	オーストラリアドル	1,009,111,848	—	1,008,412,800	699,048
	イギリスポンド	310,393,600	—	317,548,000	△7,154,400
	スウェーデンクローネ	377,857,340	—	375,648,000	2,209,340
	ユーロ	1,087,944,000	—	1,084,512,000	3,432,000
合計		4,171,248,308	—	4,187,065,600	△15,817,292

（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。

①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。

②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 3年 2月 5日現在］
1口当たり純資産額	0.9703円
(1万口当たり純資産額)	(9,703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
円	国債証券	第９５２回国庫短期証券	200,000,000	200,188,800	
		第９６０回国庫短期証券	340,000,000	340,352,240	
	国債証券 小計		540,000,000	540,541,040	
	社債券	第３４回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101,793,000	
	社債券 小計		100,000,000	101,793,000	
円合計			640,000,000	642,334,040	
アメリカドル	国債証券	0.125 T-NOTE 221130	1,000,000.00	1,000,195.31	
	国債証券 小計		1,000,000.00	1,000,195.31 (105,560,613)	

	特殊債券	1.75 ASIAN DEV 290919	1,200,000.00	1,258,381.45	
	特殊債券 小計		1,200,000.00	1,258,381.45 (132,809,578)	
	社債券	2.512 SUMITOMO MI 250122	1,000,000.00	1,049,429.20	
		3.625 SCENTRE GRO 260128	1,000,000.00	1,100,337.90	
		4 ANHEUSER-BUSCH 280413	1,000,000.00	1,157,945.47	
		4.75 ENI SPA 280912	1,000,000.00	1,200,407.20	
		FRN MACQUARIE B 240327	500,000.00	537,572.76	
	社債券 小計		4,500,000.00	5,045,692.53 (532,522,389)	
アメリカドル合計			6,700,000.00	7,304,269.29 (770,892,580)	
カナダドル	地方債証券	2.3 QUEBEC 290901	1,000,000.00	1,078,750.00	
	地方債証券 小計		1,000,000.00	1,078,750.00 (88,770,337)	
	特殊債券	1.9 IBRD 250116	2,000,000.00	2,102,800.00	
		4.55 EUROFIMA 270330	1,000,000.00	1,190,890.00	
	特殊債券 小計		3,000,000.00	3,293,690.00 (271,037,750)	
	社債券	2.975 WELLS FARGO 260519	1,000,000.00	1,081,060.00	
		FRN GOLDMAN SA 230426	1,000,000.00	1,023,670.00	
	社債券 小計		2,000,000.00	2,104,730.00 (173,198,231)	
カナダドル合計			6,000,000.00	6,477,170.00 (533,006,318)	
オーストラリアドル	特殊債券	4 KFW 250227	1,500,000.00	1,716,155.55	
	特殊債券 小計		1,500,000.00	1,716,155.55 (137,618,513)	
	社債券	1.873 CENTRAL NIP 240926	1,000,000.00	1,027,890.40	
		3 ING BANK (AUSTR 230907	1,700,000.00	1,812,418.45	
		3.45 AT&T INC 230919	2,500,000.00	2,681,205.25	
		3.5 VICINITY CENT 240426	500,000.00	531,007.10	
		3.85 GENERAL MOTO 230221	1,000,000.00	1,052,552.10	
		FRN NATIONAL A 230316	2,000,000.00	2,021,362.20	
		FRN SUNCORP-MET 210622	1,000,000.00	1,003,524.60	
	社債券 小計		9,700,000.00	10,129,960.10 (812,321,500)	
オーストラリアドル合計			11,200,000.00	11,846,115.65 (949,940,013)	
イギリスポンド	社債券	1.875 VOLKSWAGEN 210907	1,100,000.00	1,108,492.00	
		2.125 BAT CAPITAL 250815	1,000,000.00	1,046,818.00	
イギリスポンド合計			2,100,000.00	2,155,310.00 (311,269,870)	

スウェーデンクローネ	社債券	1.25 SWEDISH COVE 220615	15,000,000.00	15,273,478.50	
		1.5 STADSHYPOTEK 211215	14,000,000.00	14,191,426.20	
スウェーデンクローネ合計			29,000,000.00	29,464,904.70 (367,722,010)	
ユーロ	国債証券	1.75 O.A.T 230525	1,700,000.00	1,795,690.45	
	国債証券 小計		1,700,000.00	1,795,690.45 (226,813,660)	
	特殊債券	0.2 LB BADEN-WUER 211213	1,500,000.00	1,507,005.00	
		1.5 KFW 240611	1,000,000.00	1,071,905.80	
	特殊債券 小計		2,500,000.00	2,578,910.80 (325,742,223)	
	社債券	0.625 MACQUARIE B 270203	200,000.00	205,352.00	
		0.75 BAYER AG 270106	1,000,000.00	1,028,281.00	
		1.125 VICINITY CE 291107	1,000,000.00	1,041,297.00	
		1.45 SCENTRE GRO 290328	500,000.00	535,480.30	
		2.519 BP CAPITAL 280407	1,000,000.00	1,162,419.00	
	社債券 小計		3,700,000.00	3,972,829.30 (501,808,068)	
ユーロ合計			7,900,000.00	8,347,430.55 (1,054,363,951)	
合計				4,629,528,782 (3,987,194,742)	

(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	1銘柄	13.69%	2.28%
	特殊債券	1銘柄	17.23%	2.87%
	社債券	5銘柄	69.08%	11.50%
カナダドル	地方債証券	1銘柄	16.65%	1.92%
	特殊債券	2銘柄	50.85%	5.85%
	社債券	2銘柄	32.49%	3.74%
オーストラリアドル	特殊債券	1銘柄	14.49%	2.97%
	社債券	7銘柄	85.51%	17.55%
イギリスポンド	社債券	2銘柄	100.00%	6.72%
スウェーデンクローネ	社債券	2銘柄	100.00%	7.94%
ユーロ	国債証券	1銘柄	21.51%	4.90%
	特殊債券	2銘柄	30.89%	7.04%

	社債券	5銘柄	47.59%	10.84%

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。

三菱ＵＦＪ　国内債券アクティブマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	［令和 3年 2月 5日現在］
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	416,838,155
国債証券	7,099,482,800
社債券	4,404,392,000
未収入金	100,270,000
未収利息	26,351,817
前払費用	743,738
流動資産合計	12,048,078,510
資産合計	12,048,078,510
負債の部	
流動負債	
未払金	99,989,000
未払解約金	7,215,332
未払利息	77
流動負債合計	107,204,409
負債合計	107,204,409
純資産の部	
元本等	
元本	8,152,581,997
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	3,788,292,104
元本等合計	11,940,874,101
純資産合計	11,940,874,101
負債純資産合計	12,048,078,510

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。

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 3年 2月 5日現在]
１．　期首	令和 2年 2月 6日
期首元本額	7,183,548,238円
期中追加設定元本額	2,938,224,039円
期中一部解約元本額	1,969,190,280円
元本の内訳※	
国内債券通貨プラス	935,682,051円
国内債券セレクション（ラップ向け）	3,231,831,001円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定型）	126,221,028円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定成長型）	140,938,640円
三菱ＵＦＪ　日本バランスオープン　株式２０型	709,106,989円
三菱ＵＦＪ　日本バランスオープン　株式４０型	718,935,878円
三菱ＵＦＪ　ライフプラン　２５	455,341,263円
三菱ＵＦＪ　ライフプラン　５０	537,253,335円
三菱ＵＦＪ　ライフプラン　７５	157,412,169円
三菱ＵＦＪ　ライフプラン　５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	215,118,890円
三菱ＵＦＪ　世界バランスファンド　２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	27,551,117円
三菱ＵＦＪ　世界バランスファンド　５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	106,308,051円
三菱ＵＦＪ　ライフ・バランスファンド（安定型）	102,096,991円
三菱ＵＦＪ　ライフ・バランスファンド（安定成長型）	46,076,188円
三菱ＵＦＪ　ライフ・バランスファンド（成長型）	20,558,198円
三菱ＵＦＪ　ライフ・バランスファンド（積極型）	36,265,608円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤーファンド　２０３０	13,987,255円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤーファンド　２０４０	8,646,672円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞ライフ・バランスファンド（安定型）	84,317,247円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞ライフ・バランスファンド（安定成長型）	124,245,504円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞ライフ・バランスファンド（成長型）	55,747,953円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞ライフ・バランスファンド（積極型）	49,773,407円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞ターゲット・イヤー　ファンド　２０３０	149,722,472円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞ターゲット・イヤー　ファンド　２０４０	99,444,090円
合計	8,152,581,997円
２．　受益権の総数	8,152,581,997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 令和 2年 2月 6日 至 令和 3年 2月 5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。
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 3年 2月 5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、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。
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 3年 2月 5日現在］ 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△188,697,700
社債券	△1,997,000
合計	△190,694,700

(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

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）

	［令和 3年 2月 5日現在］
1口当たり純資産額	1.4647円
(1万口当たり純資産額)	(14,647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１４５回利付国債（５年）	100,000,000	100,997,000	
	第５回利付国債（４０年）	70,000,000	96,322,800	
	第７回利付国債（４０年）	60,000,000	78,447,000	
	第１０回利付国債（４０年）	80,000,000	85,848,800	
	第１１回利付国債（４０年）	70,000,000	72,921,100	
	第３５０回利付国債（１０年）	70,000,000	70,799,400	
	第３５１回利付国債（１０年）	90,000,000	90,997,200	
	第３５２回利付国債（１０年）	50,000,000	50,534,500	
	第３５４回利付国債（１０年）	260,000,000	262,532,400	
	第３５６回利付国債（１０年）	80,000,000	80,688,800	
	第３５７回利付国債（１０年）	80,000,000	80,636,800	
	第３６０回利付国債（１０年）	250,000,000	251,315,000	

第２３回利付国債（３０年）	40,000,000	53,235,200	
第２６回利付国債（３０年）	50,000,000	66,237,000	
第２８回利付国債（３０年）	20,000,000	27,094,400	
第３０回利付国債（３０年）	60,000,000	79,857,000	
第３１回利付国債（３０年）	30,000,000	39,560,400	
第３２回利付国債（３０年）	50,000,000	67,103,000	
第３３回利付国債（３０年）	50,000,000	64,608,000	
第３４回利付国債（３０年）	70,000,000	93,451,400	
第３６回利付国債（３０年）	70,000,000	91,357,000	
第３７回利付国債（３０年）	40,000,000	51,576,800	
第３８回利付国債（３０年）	10,000,000	12,727,400	
第３９回利付国債（３０年）	70,000,000	90,621,300	
第４２回利付国債（３０年）	70,000,000	87,947,300	
第４４回利付国債（３０年）	20,000,000	25,175,000	
第４５回利付国債（３０年）	20,000,000	24,315,600	
第４６回利付国債（３０年）	80,000,000	97,316,800	
第４７回利付国債（３０年）	20,000,000	24,804,400	
第４９回利付国債（３０年）	40,000,000	47,802,400	
第５０回利付国債（３０年）	70,000,000	73,860,500	
第５３回利付国債（３０年）	30,000,000	30,134,700	
第５４回利付国債（３０年）	100,000,000	105,107,000	
第５８回利付国債（３０年）	130,000,000	136,220,500	
第６０回利付国債（３０年）	110,000,000	117,816,600	
第６１回利付国債（３０年）	70,000,000	71,330,000	
第６７回利付国債（３０年）	120,000,000	118,374,000	
第９９回利付国債（２０年）	80,000,000	91,971,200	
第１００回利付国債（２０年）	70,000,000	81,266,500	
第１０３回利付国債（２０年）	50,000,000	58,660,000	
第１０５回利付国債（２０年）	50,000,000	58,149,000	
第１１０回利付国債（２０年）	50,000,000	58,610,000	
第１１１回利付国債（２０年）	60,000,000	71,096,400	
第１１３回利付国債（２０年）	50,000,000	59,044,000	
第１１４回利付国債（２０年）	50,000,000	59,253,500	
第１１６回利付国債（２０年）	70,000,000	83,837,600	
第１１８回利付国債（２０年）	60,000,000	71,001,000	
第１２１回利付国債（２０年）	60,000,000	70,653,600	
第１２３回利付国債（２０年）	110,000,000	132,130,900	
第１２５回利付国債（２０年）	130,000,000	157,955,200	
第１２８回利付国債（２０年）	120,000,000	142,516,800	
第１３０回利付国債（２０年）	150,000,000	177,058,500	
第１３２回利付国債（２０年）	90,000,000	105,531,300	
第１３６回利付国債（２０年）	80,000,000	93,133,600	

	第１３７回利付国債（２０年）	80,000,000	94,220,000	
	第１４０回利付国債（２０年）	60,000,000	70,817,400	
	第１４１回利付国債（２０年）	80,000,000	94,617,600	
	第１４３回利付国債（２０年）	100,000,000	117,315,000	
	第１４５回利付国債（２０年）	110,000,000	130,612,900	
	第１４６回利付国債（２０年）	130,000,000	154,657,100	
	第１４７回利付国債（２０年）	70,000,000	82,548,200	
	第１４８回利付国債（２０年）	60,000,000	70,053,600	
	第１４９回利付国債（２０年）	110,000,000	128,609,800	
	第１５０回利付国債（２０年）	120,000,000	138,900,000	
	第１５２回利付国債（２０年）	140,000,000	158,558,400	
	第１５３回利付国債（２０年）	130,000,000	149,130,800	
	第１５４回利付国債（２０年）	100,000,000	113,393,000	
	第１５５回利付国債（２０年）	130,000,000	143,663,000	
	第１５８回利付国債（２０年）	90,000,000	92,615,400	
	第１５９回利付国債（２０年）	120,000,000	125,260,800	
	第１６０回利付国債（２０年）	40,000,000	42,328,400	
	第１６２回利付国債（２０年）	180,000,000	187,358,400	
	第１６４回利付国債（２０年）	30,000,000	30,676,800	
	第１６６回利付国債（２０年）	220,000,000	231,811,800	
	第１６７回利付国債（２０年）	70,000,000	71,285,200	
	第１７２回利付国債（２０年）	80,000,000	79,505,600	
国債証券 合計		6,280,000,000	7,099,482,800	
社債券	第２３回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	99,914,000	
	第３回香港上海銀行	100,000,000	99,496,000	
	第３回マラヤン・バンキング（２０１９）	200,000,000	200,068,000	
	第６回マラヤン・バンキング	200,000,000	199,486,000	
	第１回バークレイズ・ピーエルシー期限前償還条項付	100,000,000	101,046,000	
	第３回ソシエテ　ジェネラル円貨社債（２０１８）	100,000,000	100,402,000	
	ＵＢＳ　ＧＲＯＵＰ　ＦＵＮＤＩＮＧ（ＳＷＩＴＺＥＲＬＡＮＤ）	100,000,000	100,088,000	
	第１４回セブン&アイ・ホールディングス	100,000,000	100,388,000	
	第１６回Ｚホールディングス	100,000,000	100,154,000	
	第５０回日本電気	100,000,000	100,148,000	
	第３４回ソニー	100,000,000	99,580,000	
	第４３回ＩＨＩ	100,000,000	99,477,000	
	第４７回ＩＨＩ	100,000,000	100,139,000	
	第１回日本生命２０１７基金	100,000,000	100,067,000	
	第９回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	100,000,000	99,910,000	
	第１回明治安田生命２０１８基金	100,000,000	100,172,000	
	第１回日本生命２０１９基金	100,000,000	100,005,000	

	第１回明治安田生命２０１９基金	100,000,000	100,039,000	
	第１回楽天カード	100,000,000	99,799,000	
	第３５回丸井グループ	100,000,000	99,694,000	
	第２７回あおぞら銀行	100,000,000	100,067,000	
	第１３回三井住友トラスト・ホールディングス期限前償還条項付	100,000,000	99,866,000	
	第８回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）	100,000,000	101,040,000	
	第１８回みずほフィナンシャルグループ期限前償還条項付	100,000,000	99,794,000	
	第１６回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	100,000,000	100,364,000	
	第１４回ＳＢＩホールディングス	100,000,000	100,023,000	
	第１９回ＳＢＩホールディングス	100,000,000	99,748,000	
	第２３回ＳＢＩホールディングス	100,000,000	99,961,000	
	第５回イオンフィナンシャルサービス	100,000,000	100,035,000	
	第７回イオンフィナンシャルサービス	200,000,000	199,708,000	
	第７５回アコム	100,000,000	100,081,000	
	第７９回アコム	100,000,000	99,369,000	
	第１回野村ホールディングス	100,000,000	99,900,000	
	第２回野村ホールディングス	100,000,000	99,723,000	
	第２回ソフトバンク	100,000,000	99,683,000	
	第８回ソフトバンク	100,000,000	100,025,000	
	第５００回関西電力	100,000,000	101,445,000	
	第２回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,524,000	
	第１２回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,660,000	
	第２７回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101,227,000	
	第３８回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101,077,000	
社債券 合計		4,400,000,000	4,404,392,000	
合計		10,680,000,000	11,503,874,800	

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。

フランス国債７－１０年ラダーマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	［令和 3年 2月 5日現在］
資産の部	
流動資産	
預金	249,045,883
コール・ローン	322,009,973
国債証券	20,821,064,563
未収利息	80,759,450
前払費用	187,820
流動資産合計	21,473,067,689
資産合計	21,473,067,689
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	18,315,934
未払解約金	2,334,650
未払利息	59
流動負債合計	20,650,643
負債合計	20,650,643
純資産の部	
元本等	
元本	18,675,694,876
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,776,722,170
元本等合計	21,452,417,046
純資産合計	21,452,417,046
負債純資産合計	21,473,067,689

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 3年 2月 5日現在]
１． 期首	令和 2年 2月 6日
期首元本額	26,537,254,119円
期中追加設定元本額	2,351,698,975円
期中一部解約元本額	10,213,258,218円
元本の内訳※	
国内債券セレクション（ラップ向け）	409,686,814円
フランス国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）（ラップ向け）	431,335,658円

	[令和 3年 2月 5日現在]
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	18,260,222円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	19,455,963円
ＭＵＫＡＭ　フランス国債７－１０年ラダーオープン（為替ヘッジあり）（適格機関投資家転売制限付）	2,605,556,611円
ＭＵＫＡＭ　フランス国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）２０１７－０６（適格機関投資家限定）	747,211,166円
ＭＵＫＡＭ　フランス国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）２０１８－０６（適格機関投資家限定）	1,952,354,826円
ＭＵＫＡＭ　フランス国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）２０１８－０７（適格機関投資家限定）	3,712,373,889円
ＭＵＫＡＭ　フランス国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）２０１８－１０（適格機関投資家限定）	749,324,390円
ＭＵＫＡＭ　フランス国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）２０１８－１１（適格機関投資家限定）	2,785,754,522円
ＭＵＫＡＭ　フランス国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）２０１９－０１（適格機関投資家限定）	3,892,430,575円
ＭＵＫＡＭ　フランス国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）２０１９－０５（適格機関投資家限定）	1,351,950,240円
合計	18,675,694,876円
２．　受益権の総数	18,675,694,876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 令和 2年 2月 6日 至 令和 3年 2月 5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。

区分	自 令和 2年 2月 6日 至 令和 3年 2月 5日
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 3年 2月 5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 3年 2月 5日現在］ 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△66,595,026
合計	△66,595,026

(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 3年 2月 5日現在］

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	ユーロ	21,037,508,466	—	21,055,824,400	△18,315,934
合計		21,037,508,466	—	21,055,824,400	△18,315,934

（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。

①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。

②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 3年 2月 5日現在］
1口当たり純資産額	1.1487円
(1万口当たり純資産額)	(11,487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
ユーロ	国債証券	0 0.A.T 291125	26,720,000.00	27,469,629.60	
		0 0.A.T 301125	26,810,000.00	27,440,571.20	
		0.5 0.A.T 290525	25,628,000.00	27,484,159.15	

		0.75 0.A.T 280525	25,292,000.00	27,512,637.60	
		0.75 0.A.T 281125	25,201,000.00	27,493,585.37	
		2.5 0.A.T 300525	21,710,000.00	27,440,400.09	
ユーロ合計			151,361,000.00	164,840,983.01 (20,821,064,563)	
合計				20,821,064,563 (20,821,064,563)	

(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
ユーロ	国債証券　6銘柄	100.00%	100.00%

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。

ヘッジ付スペイン国債７－１０年ラダーマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	［令和 3年 2月 5日現在］
資産の部	
流動資産	
預金	69,730,282
コール・ローン	223,229,816
国債証券	13,560,292,951
未収利息	101,519,537
前払費用	3,911,684
流動資産合計	13,958,684,270
資産合計	13,958,684,270
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,897,774
未払解約金	8,760,965
未払利息	41
流動負債合計	20,658,780
負債合計	20,658,780
純資産の部	

	［令和 3年 2月 5日現在］
元本等	
元本	12,744,353,076
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,193,672,414
元本等合計	13,938,025,490
純資産合計	13,938,025,490
負債純資産合計	13,958,684,270

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 3年 2月 5日現在]
１． 期首	令和 2年 2月 6日
期首元本額	11,652,468,485円
期中追加設定元本額	5,687,959,127円
期中一部解約元本額	4,596,074,536円
元本の内訳※	
国内債券セレクション（ラップ向け）	862,369,240円
スペイン国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）（ラップ向け）	1,676,379,023円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	35,381,215円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	38,529,210円
ＭＵＫＡＭ　スペイン国債７－１０年ラダーオープン（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	2,786,384,077円
ＭＵＫＡＭ　スペイン国債７－１０年ラダーオープン（為替ヘッジあり）（適格機関投資家転売制限付）	1,861,253,792円
ＭＵＫＡＭ　スペイン国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）２０１９－０４（適格機関投資家限定）	3,966,465,806円
ＭＵＫＡＭ　スペイン国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）２０１９－０６（適格機関投資家限定）	764,755,346円
ＭＵＫＡＭ　スペイン国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）２０１９－０７（適格機関投資家限定）	752,835,367円
合計	12,744,353,076円
２． 受益権の総数	12,744,353,076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 令和 2年 2月 6日 至 令和 3年 2月 5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 3年 2月 5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。

区分	［令和 3年 2月 5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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	［令和 3年 2月 5日現在］
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	98,678,549
合計	98,678,549

(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 3年 2月 5日現在］

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 ユーロ	13,665,670,626	―	13,677,568,400	△11,897,774
合計		13,665,670,626	―	13,677,568,400	△11,897,774

（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。

①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。

②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 3年 2月 5日現在］
1口当たり純資産額	1.0937円
(1万口当たり純資産額)	(10,937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
ユーロ	国債証券	0.5 SPAIN GOVT 300430	34,580,000.00	35,957,701.78	
		1.4 SPAIN GOVT 280430	32,120,000.00	35,682,763.24	
		1.45 SPAIN GOVT 290430	31,840,000.00	35,716,774.72	
ユーロ合計			98,540,000.00	107,357,239.74 (13,560,292,951)	
合計				13,560,292,951 (13,560,292,951)	

(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
ユーロ	国債証券　3銘柄	100.00%	100.00%

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】

【国内債券セレクション（ラップ向け）】

【純資産額計算書】

令和 3年 2月26日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	24,321,025,541
Ⅱ　負債総額	76,821,907
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	24,244,203,634
Ⅳ　発行済口数	23,405,454,550口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0358
（10,000口当たり）	（10,358）

（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 3年 2月26日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	337,992,443,789
Ⅱ　負債総額	5,770,930,197
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	332,221,513,592
Ⅳ　発行済口数	249,310,776,110口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3326
（10,000口当たり）	（13,326）

先進国高格付国債マザーファンド

純資産額計算書

令和 3年 2月26日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	99,945,232,462
Ⅱ　負債総額	5,417,171,714
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	94,528,060,748
Ⅳ　発行済口数	83,659,674,080口

Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1299
（10,000口当たり）	（11,299）

ＭＵＡＭ　ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド

純資産額計算書

令和 3年 2月26日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	178,077,489,436
Ⅱ　負債総額	3,076,885,556
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	175,000,603,880
Ⅳ　発行済口数	100,932,816,407口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7338
（10,000口当たり）	（17,338）

ショートデュレーション円インカムマザーファンド

純資産額計算書

令和 3年 2月26日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	7,847,887,783
Ⅱ　負債総額	122,114,017
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	7,725,773,766
Ⅳ　発行済口数	7,964,496,685口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9700
（10,000口当たり）	（9,700）

三菱ＵＦＪ　国内債券アクティブマザーファンド

純資産額計算書

令和 3年 2月26日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	12,126,493,882
Ⅱ　負債総額	88,053,627
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	12,038,440,255
Ⅳ　発行済口数	8,291,134,428口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4520

（10,000口当たり）	（14,520）

フランス国債７－１０年ラダーマザーファンド

純資産額計算書

令和 3年 2月26日現在

（単位：円）

Ⅰ　資産総額	21,039,167,487
Ⅱ　負債総額	478,401,368
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	20,560,766,119
Ⅳ　発行済口数	18,261,910,229口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1259
（10,000口当たり）	（11,259）

ヘッジ付スペイン国債７－１０年ラダーマザーファンド

純資産額計算書

令和 3年 2月26日現在

（単位：円）

Ⅰ　資産総額	13,978,998,899
Ⅱ　負債総額	317,207,239
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	13,661,791,660
Ⅳ　発行済口数	12,748,539,448口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0716
（10,000口当たり）	（10,716）

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

①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。

②上記①の申請のある場合には、上記①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①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。

③上記①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。

第二部【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

2021年2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

①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。

②運用戦略の決定

運用戦略委員会において、①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。

③運用計画の決定

②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。

④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。

⑤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。

⑥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。

⑦ファンドに関係する法人等の管理

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。

⑧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。
2021年 2月26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	877	16,102,922
追加型公社債投資信託	16	1,541,493
単位型株式投資信託	75	334,899
単位型公社債投資信託	38	176,313
合　計	1,006	18,155,626

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35期事業年度（自 平成31年4月1日 至 令和2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36期事業年度に係る中間会計期間（自 令和2年4月1日 至 令和2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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)

(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	※2	53,969,686	※2	56,398,457
有価証券		1,403,513		1,960,318
前払費用		514,587		575,904
未収入金		2,284		14,559
未収委託者報酬		9,995,458		10,296,453
未収収益	※2	560,483	※2	638,994
金銭の信託	※2	100,000	※2	100,000
その他		153,256		254,330
流動資産合計		66,699,271		70,239,017
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	617,032	※1	584,048
器具備品	※1	665,247	※1	871,893
土地		628,433		628,433
有形固定資産合計		1,910,713		2,084,375
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		3,670,753		3,369,611
ソフトウェア仮勘定		536,345		1,374,932
無形固定資産合計		4,222,921		4,760,365
投資その他の資産				
投資有価証券		21,408,781		16,704,756
関係会社株式		320,136		320,136
投資不動産	※1	824,268	※1	819,255
長期差入保証金		593,536		565,358
前払年金費用		415,234		375,031
繰延税金資産		1,496,180		1,912,824
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		25,079,767		20,718,993
固定資産合計		31,213,401		27,563,734
資産合計		97,912,673		97,802,752

(単位：千円)

	第34期 (平成31年3月31日現在)		第35期 (令和2年3月31日現在)	
(負債の部)				
流動負債				
預り金		293,258		687,565
未払金				
未払収益分配金		170,281		131,478
未払償還金		448,695		395,400
未払手数料	※2	3,990,054	※2	4,026,078
その他未払金	※2	3,961,765	※2	3,818,195
未払費用	※2	3,803,995	※2	4,402,578
未払消費税等		194,852		629,469
未払法人税等		573,657		617,341

賞与引当金	901,135	933,517
役員賞与引当金	140,100	124,590
その他	868,992	701,285
流動負債合計	15,346,788	16,467,499
固定負債		
長期未払金	43,200	32,400
退職給付引当金	860,851	1,010,401
役員退職慰労引当金	144,303	130,784
時効後支払損引当金	247,767	238,811
固定負債合計	1,296,122	1,412,398
負債合計	16,642,910	17,879,897
(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	26,069,594	25,847,605
利益剰余金合計	33,410,184	33,188,194
株主資本合計	80,143,028	79,921,039

(単位：千円)

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2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	1,126,733	1,815
評価・換算差額等合計	1,126,733	1,815
純資産合計	81,269,762	79,922,854
負債純資産合計	97,912,673	97,802,752

（２）【損益計算書】

(単位：千円)

	第34期 （自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	70,375,414	67,967,489
投資顧問料	2,505,299	2,385,084
その他営業収益	18,844	16,085
営業収益合計	72,899,557	70,368,658

営業費用				
支払手数料	※2	28,533,952	※2	27,106,451
広告宣伝費		739,643		696,418
公告費		500		1,000
調査費				
調査費		1,794,755		1,857,271
委託調査費		12,194,996		11,579,175
事務委託費		1,016,816		847,769
営業雑経費				
通信費		170,794		153,731
印刷費		427,442		427,118
協会費		48,375		52,053
諸会費		16,175		15,990
事務機器関連費		1,841,631		1,953,926
営業費用合計		46,785,083		44,690,907
一般管理費				
給料				
役員報酬		349,083		331,987
給料・手当		6,453,717		6,611,427
賞与引当金繰入		901,135		933,517
役員賞与引当金繰入		140,100		124,590
福利厚生費		1,234,293		1,276,950
交際費		13,011		11,871
旅費交通費		200,426		165,891
租税公課		373,201		360,165
不動産賃借料		654,886		647,402
退職給付費用		428,912		422,919
役員退職慰労引当金繰入		51,159		48,183
固定資産減価償却費		1,252,321		1,307,555
諸経費		523,213		427,212
一般管理費合計		12,575,461		12,669,674
営業利益		13,539,012		13,008,076

（単位：千円）

	第34期 （自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）		第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金		181,073		90,965
受取利息	※2	1,913	※2	4,169
投資有価証券償還益		416,706		585,179
収益分配金等時効完成分		44,392		101,734
受取賃貸料	※2	38,388	※2	65,808
その他		11,871		19,987
営業外収益合計		694,346		867,845
営業外費用				
投資有価証券償還損		118,173		96,379
時効後支払損引当金繰入		1,166		-
事務過誤費		420		3,483
賃貸関連費用		35,994		20,339
その他		1,481		1,920

営業外費用合計		157,235		122,122
経常利益		14,076,123		13,753,799
特別利益				
投資有価証券売却益		501,778		174,842
特別利益合計		501,778		174,842
特別損失				
投資有価証券売却損		135,399		75,963
投資有価証券評価損		62,310		163,865
固定資産除却損	※1	4,848	※1	8,832
固定資産売却損		225		435
システム関連費		322,986		-
商標使用料		90,000		-
特別損失合計		615,770		249,096
税引前当期純利益		13,962,130		13,679,545
法人税、住民税及び事業税	※2	4,420,179	※2	4,146,534
法人税等調整額		△100,112		79,824
法人税等合計		4,320,066		4,226,359
当期純利益		9,642,064		9,453,186

（３）【株主資本等変動計算書】

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	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

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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	26,069,594	33,410,184	80,143,028
当期変動額									
剰余金の配当							△9,675,175	△9,675,175	△9,675,175
当期純利益							9,453,186	9,453,186	9,453,186
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	―	―	―	―	―	―	△221,989	△221,989	△221,989
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	25,847,605	33,188,194	79,921,039

	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
当期変動額			
剰余金の配当			△9,675,175
当期純利益			9,453,186
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△1,124,917	△1,124,917	△1,124,917
当期変動額合計	△1,124,917	△1,124,917	△1,346,907
当期末残高	1,815	1,815	79,922,854

[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。
①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。
②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。
(3)「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」の適用
令和2年度税制改正において従来の連結納税制度が見直され、グループ通算制度に移行する税制改正法（「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号））が令和2年3月27日に成立しておりますが、繰延税金資産の額について、実務対応報告第39号「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」により企業会計基準適用指針第28号「税効果会計に係る会計基準の適用指針」第44項の定めを適用せず、改正前の税法の規定に基づいて算定しております。

（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 令和2年3月31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 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）
・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31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。

・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31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）が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス（国際財務報告基準（IFRS）においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」）を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定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、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定め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

「時価の算定に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で未定であります。

（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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
建物	551,025千円	599,542千円
器具備品	1,350,407千円	1,408,613千円
投資不動産	138,024千円	145,391千円

※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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
預金	240,211千円	314,247千円
未収収益	25,307千円	15,773千円
金銭の信託	100,000千円	100,000千円
未払手数料	671,568千円	712,210千円
その他未払金	3,217,341千円	3,029,426千円
未払費用	444,754千円	432,019千円

（損益計算書関係）

※1.固定資産除却損の内訳

	第34期 （自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）
建物	2,547千円	―
器具備品	2,301千円	8,832千円

計	4,848千円	8,832千円

※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34期 （自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）
支払手数料	5,298,064千円	5,234,629千円
受取利息	3千円	2千円
受取賃貸料	38,388千円	65,808千円
法人税、住民税及び事業税	3,216,517千円	3,030,180千円

（株主資本等変動計算書関係）
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。
① 配当金の総額 11,363,380千円
② １株当たり配当額 53,707円
③ 基準日 平成30年3月31日
④ 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。
① 配当金の総額 9,675,175千円
② 配当の原資 利益剰余金
③ １株当たり配当額 45,728円
④ 基準日 平成31年3月31日
⑤ 効力発生日 令和 元年6月27日

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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
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。
① 配当金の総額 9,675,175千円
② １株当たり配当額 45,728円
③ 基準日 平成31年3月31日
④ 効力発生日 令和 元年6月27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2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。

①	配当金の総額	9,457,670千円
②	配当の原資	利益剰余金
③	１株当たり配当額	44,700円
④	基準日	令和2年3月31日
⑤	効力発生日	令和2年6月29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34期 （平成31年3月31日現在）	第35期 （令和2年3月31日現在）
1年内	675,956千円	675,956千円
1年超	675,956千円	―
合計	1,351,912千円	675,956千円

（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	―

第35期(令和2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	56,398,457	56,398,457	―
(2)	有価証券	1,960,318	1,960,318	―
(3)	未収委託者報酬	10,296,453	10,296,453	―
(4)	投資有価証券	16,673,396	16,673,396	―
	資産計	85,328,625	85,328,625	―

(1)　未払手数料	4,026,078	4,026,078	―
負債計	4,026,078	4,026,078	―

（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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
非上場株式	55,360	31,360
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

第35期(令和2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	56,398,457	―	―	―
未収委託者報酬	10,296,453	―	―	―
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	1,960,318	5,652,257	4,813,929	27,375
合計	68,655,228	5,652,257	4,813,929	27,375

（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

第35期(令和2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	9,859,345	8,694,010	1,165,334
	小計	9,859,345	8,694,010	1,165,334
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	8,774,369	9,937,087	△1,162,718
	小計	8,774,369	9,937,087	△1,162,718
合計		18,633,714	18,631,098	2,616

3.売却したその他有価証券

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

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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	8,940	―	15,060
債券	―	―	―
その他	2,035,469	174,842	60,903
合計	2,044,409	174,842	75,963

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。

当事業年度において、有価証券について163,865千円（その他有価証券のその他163,865千円）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34期 （自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）
退職給付債務の期首残高	3,729,252 千円	3,712,289 千円
勤務費用	193,531	204,225
利息費用	24,351	17,557
数理計算上の差異の発生額	△15,898	△52,430
退職給付の支払額	△218,947	△162,904
過去勤務費用の発生額	―	―
退職給付債務の期末残高	3,712,289	3,718,736

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第34期 （自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）
年金資産の期首残高	2,723,393 千円	2,666,937 千円
期待運用収益	48,664	47,757
数理計算上の差異の発生額	△4,606	△164,633
事業主からの拠出額	102,564	51,282
退職給付の支払額	△203,077	△140,518
年金資産の期末残高	2,666,937	2,460,824

(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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	3,125,760 千円	2,969,807 千円
年金資産	△2,666,937	△2,460,824
	458,822	508,982
非積立型制度の退職給付債務	586,529	748,929
未積立退職給付債務	1,045,351	1,257,911
未認識数理計算上の差異	△ 114,968	△203,136
未認識過去勤務費用	△ 484,766	△419,405
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	445,616	635,370
退職給付引当金	860,851	1,010,401
前払年金費用	△415,234	△375,031
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	445,616	635,370

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第34期 （自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）
勤務費用	193,531 千円	204,225 千円

利息費用	24,351	17,557
期待運用収益	△48,664	△47,757
数理計算上の差異の費用処理額	43,633	24,035
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	5,986	6,427
確定給付制度に係る退職給付費用	284,199	269,848

（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です。

(5)年金資産に関する事項

①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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
債券	63.9 %	64.7 %
株式	33.2	32.3
その他	2.9	3.0
合計	100	100

②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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
割引率	0.035～0.49%	0.095～0.52%
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144,712千円、当事業年度153,070千円であります。

（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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	436,050千円	427,046千円
投資有価証券評価損	223,821	226,322
未払事業税	109,109	117,461
賞与引当金	275,927	285,842
役員賞与引当金	19,428	19,703
役員退職慰労引当金	44,185	40,046
退職給付引当金	263,592	309,384
減価償却超過額	157,741	96,767
委託者報酬	264,398	213,044
長期差入保証金	31,721	40,180
時効後支払損引当金	75,866	73,124
連結納税適用による時価評価	148,858	57,656
その他	71,320	123,248
繰延税金資産　小計	2,122,023	2,029,829

評価性引当額	―	―
繰延税金資産　合計	2,122,023	2,029,829
繰延税金負債		
前払年金費用	△127,144	△114,834
連結納税適用による時価評価	△1,320	△1,260
その他有価証券評価差額金	△497,269	△801
その他	△108	△109
繰延税金負債　合計	△625,842	△117,005
繰延税金資産の純額	1,496,180	1,912,824

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34期（平成31年3月31日現在）及び第35期（令和2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34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）及び第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）及び第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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㈱	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 投資の助言 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注2） 投資助言料（注3）	5,298,064千円 695,834千円	未払手数料 未払費用	671,568千円 365,510千円

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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）	3,030,180千円	その他未払金	3,029,426千円
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 投資の助言 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注2） 投資助言料（注3）	5,234,629千円 583,270千円	未払手数料 未払費用	712,210千円 302,681千円

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。

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

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	㈱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

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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銀行	東京都千代田区	1,711,958百万円	銀行業	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）	4,073,855千円	未払手数料	697,109千円
						取引銀行	コーラブル預金の払戻（注3）	20,000,000千円		
							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）	4,126千円	未収収益	997千円
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）	5,714,501千円	未払手数料	944,351千円

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。

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．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。
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。

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34期 （自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）
１株当たり純資産額	384,107.08円	377,741.17円
１株当たり当期純利益金額	45,571.50円	44,678.80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、記載しておりません。
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34期 （自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）
当期純利益金額　（千円）	9,642,064	9,453,186
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）	9,642,064	9,453,186
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36期中間会計期間 (令和2年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金及び預金		51,757,620
有価証券		47,281
前払費用		533,748
未収入金		22,328
未収委託者報酬		11,205,707
未収収益		1,109,882
金銭の信託		200,000
その他		216,914
流動資産合計		65,093,483
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1	561,961
器具備品	※1	1,130,570
土地		628,433
有形固定資産合計		2,320,965
無形固定資産		
電話加入権		15,822
ソフトウェア		3,039,396

ソフトウェア仮勘定		2,003,918
無形固定資産合計		5,059,137
投資その他の資産		
投資有価証券		17,150,138
関係会社株式		320,136
投資不動産	※1	817,921
長期差入保証金		552,888
前払年金費用		316,933
繰延税金資産		1,088,156
その他		45,230
貸倒引当金		△23,600
投資その他の資産合計		20,267,805
固定資産合計		27,647,907
資産合計		92,741,391

(単位：千円)

	第36期中間会計期間 (令和2年9月30日現在)	
(負債の部)		
流動負債		
預り金		326,091
未払金		
未払収益分配金		158,732
未払償還金		133,877
未払手数料		4,401,647
その他未払金		2,173,325
未払費用		4,669,476
未払消費税等	※2	507,145
未払法人税等		523,722
賞与引当金		895,400
役員賞与引当金		76,200
その他		699,988
流動負債合計		14,565,607
固定負債		
長期未払金		21,600
退職給付引当金		1,075,559
役員退職慰労引当金		133,578
時効後支払損引当金		248,354
固定負債合計		1,479,092
負債合計		16,044,700
(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		20,902,380
利益剰余金合計		28,242,970
株主資本合計		74,975,814

(単位：千円)

	第36期中間会計期間 (令和2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	1,720,876
評価・換算差額等合計	1,720,876
純資産合計	76,696,691
負債純資産合計	92,741,391

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第36期中間会計期間 （自 令和2年4月1日 至 令和2年9月30日）
営業収益		
委託者報酬		32,500,161
投資顧問料		1,178,818
その他営業収益		6,615
営業収益合計		33,685,595
営業費用		
支払手数料		12,792,753
広告宣伝費		275,488
公告費		250
調査費		
調査費		1,005,823
委託調査費		5,663,034
事務委託費		344,079
営業雑経費		
通信費		208,539
印刷費		182,427
協会費		26,229
諸会費		8,309
事務機器関連費		917,566
その他営業雑経費		126
営業費用合計		21,424,626
一般管理費		
給料		
役員報酬		171,181
給料・手当		2,786,316
賞与引当金繰入		895,400
役員賞与引当金繰入		76,200
福利厚生費		625,724
交際費		1,235
旅費交通費		10,767
租税公課		186,405
不動産賃借料		327,689
退職給付費用		229,835
役員退職慰労引当金繰入		11,763
固定資産減価償却費	※1	643,956
諸経費		188,448
一般管理費合計		6,154,923
営業利益		6,106,045

(単位：千円)

	第36期中間会計期間 （自 令和2年4月1日 至 令和2年9月30日）
営業外収益	
受取配当金	17,539
受取利息	2,089
投資有価証券償還益	24,505
収益分配金等時効完成分	275,165
受取賃貸料	32,904
その他	9,312
営業外収益合計	361,516
営業外費用	
投資有価証券償還損	37,772
時効後支払損引当金繰入	13,892
賃貸関連費用	※1 6,562
その他	2,149
営業外費用合計	60,377
経常利益	6,407,184
特別利益	
投資有価証券売却益	157,075
特別利益合計	157,075
特別損失	
投資有価証券売却損	37,339
特別損失合計	37,339
税引前中間純利益	6,526,919
法人税、住民税及び事業税	1,948,492
法人税等調整額	65,981
法人税等合計	2,014,473
中間純利益	4,512,445

(3)中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 令和2年4月1日 至 令和2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	25,847,605	33,188,194	79,921,039
当中間期変動額									
剰余金の配当							△9,457,670	△9,457,670	△9,457,670
中間純利益							4,512,445	4,512,445	4,512,445
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	―	―	―	―	―	―	△4,945,224	△4,945,224	△4,945,224
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	20,902,380	28,242,970	74,975,814

	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	1,815	1,815	79,922,854
当中間期変動額			

剰余金の配当			△9,457,670
中間純利益			4,512,445
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	1,719,061	1,719,061	1,719,061
当中間期変動額合計	1,719,061	1,719,061	△3,226,163
当中間期末残高	1,720,876	1,720,876	76,696,691

[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。

(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。

① 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。

② 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。

(3) 「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」の適用

令和2年度税制改正において従来の連結納税制度が見直され、グループ通算制度に移行する税制改正法（「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号））が令和2年3月27日に成立しておりますが、繰延税金資産の額について、実務対応報告第39号「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」により企業会計基準適用指針第28号「税効果会計に係る会計基準の適用指針」第44項の定めを適用せず、改正前の税法の規定に基づいて算定しております。

[注記事項]

（中間貸借対照表関係）

※1 減価償却累計額

	第36期中間会計期間 （令和2年9月30日現在）
建物	621,629千円
器具備品	1,475,730千円
投資不動産	148,595千円

※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36期中間会計期間 （自 令和2年4月1日 至 令和2年9月30日）
有形固定資産	83,458千円
無形固定資産	560,498千円
投資不動産	3,204千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第36期中間会計期間（自 令和2年4月1日 至 令和2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2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。

①	配当金の総額	9,457,670千円
②	配当の原資	利益剰余金
③	１株当たり配当額	44,700円
④	基準日	令和2年3月31日
⑤	効力発生日	令和2年6月29日

（リース取引関係）

第36期中間会計期間(令和2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	337,978千円
1年超	－
合　　計	337,978千円

（金融商品関係）

第36期中間会計期間(令和2年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

令和2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	51,757,620	51,757,620	－
(2)　有価証券	47,281	47,281	－
(3)　未収委託者報酬	11,205,707	11,205,707	－
(4)　投資有価証券	17,118,778	17,118,778	－
資産計	80,129,387	80,129,387	－
(1)　未払手数料	4,401,647	4,401,647	－
負債計	4,401,647	4,401,647	－

（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

非上場株式（中間貸借対照表計上額31,360千円）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36期中間会計期間（令和2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	14,690,037	11,992,800	2,697,236
	小　計	14,690,037	11,992,800	2,697,236
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	2,476,022	2,692,895	△216,872
	小　計	2,476,022	2,692,895	△216,872
合　計		17,166,060	14,685,695	2,480,364

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額31,360千円）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。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第36期中間会計期間（自 令和2年4月1日 至 令和2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36期中間会計期間（自 令和2年4月1日 至 令和2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36期中間会計期間（令和2年9月30日現在）
1株当たり純資産額	362,493.28円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額（千円）	76,696,691
普通株式に係る中間期末の純資産額（千円）	76,696,691
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36期中間会計期間 （自 令和2年4月1日 至 令和2年9月30日）
1株当たり中間純利益金額	21,327.27円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額（千円）	4,512,445
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）	4,512,445
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、記載しておりません。

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。

①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。)。

②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。)。

③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④⑤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。

④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。

⑤上記③④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】

①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。

②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

①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）

②資本金の額：324,279百万円（2020年９月末現在）

③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

①名称	②資本金の額 （2020年９月末現在）	③事業の内容
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。

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。（2021年2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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年 5月 1日	有価証券届出書
2020年 5月 1日	有価証券報告書
2020年11月 4日	有価証券届出書の訂正届出書
2020年11月 4日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

令和2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
東　京　事　務　所

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

監査意見
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。
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令和2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、全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。

監査意見の根拠
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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任
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。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。
監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- **不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。**
- **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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。**

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

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３年３月10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
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　鶴田　光夫　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　和田　渉　印

監査意見
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」に掲げられている国内債券セレクション（ラップ向け）の令和２年２月６日から令和３年２月５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。
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、国内債券セレクション（ラップ向け）の令和３年２月５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。

監査意見の根拠
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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三菱ＵＦＪ国際投信株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
・　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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・　経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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2年11月30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
東　京　事　務　所

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

中間監査意見

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令和2年4月1日から令和3年3月31日までの第36期事業年度の中間会計期間（令和2年4月1日から令和2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。

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2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（令和2年4月1日から令和2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。

中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- **不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。**
- **中間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、監査人は、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。**
- **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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。**

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

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。