

【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10月21日提出
【計算期間】	第14期(自 2020年7月23日至 2021年7月26日)
【ファンド名】	三菱ＵＦＪ ＤＣ金利連動アロケーション型バランスファンド
【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 1 2 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 1 2 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、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、5,000億円です。

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

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

商品分類表

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

属性区分表

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

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

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源

泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

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

商品分類の定義

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

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

属性区分の定義

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

	公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（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。
投資対象地域	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。
	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

内外の株式や債券を実質的な主要投資対象とし、わが国の短期金利水準の変動に応じて投資配分比率を変動させることにより、安定した収益の確保と着実な値上がり益の獲得をめざします。

ファンドの特色

特色1

主として、三菱UFJ 日本株アクティブマザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド、三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンドへの投資を通じて国内株式、国内債券、外国株式、外国債券に分散投資を行うバランス型運用部分と、マネー・マーケット・マザーファンドへの投資を通じてわが国の短期公社債に投資を行う安定運用部分に、それぞれ投資を行います。

マザーファンドの基本方針は以下の通りです。

ファンド名	基本方針
三菱UFJ 日本株アクティブマザーファンド	ボトムアップ・アプローチを基本としたアクティブ運用により長期的にわが国の株式市場全体(TOPIX)の動きを上回る運用成果をめざします。 *上記は2022年4月4日以降、東京証券取引所の市場区分見直しに伴い、以下の通り変更となります。 ボトムアップ・アプローチを基本としたアクティブ運用により長期的にTOPIXの動きを上回る運用成果をめざします。
日本債券マザーファンド	NOMURA-BPI総合インデックスをベンチマーク ^(注1) とし、同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。
外国株式マザーファンド	MSCI Kokusai Index (MSCIコクサイ インデックス) (円換算ベース)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ます。 運用の指図に関する権限は、ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッド ^(注2) に委託します。 ^(注3)
三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド	FTSE世界国債インデックス(除く日本・円ベース)をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果をめざします。
マネー・マーケット・マザーファンド	わが国の短期公社債等を中心に投資し、利子等収益の確保を図ります。

(注1)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。

(注2)ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッドは、ブラックロック・インク(ニューヨーク証券取引所に上場)の英国現地法人であり、高い専門性に基いた資産運用サービスを提供しています。

(注3)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。

特色2

バランス型運用部分における各資産への配分比率は、以下の比率とすることを基本とします。

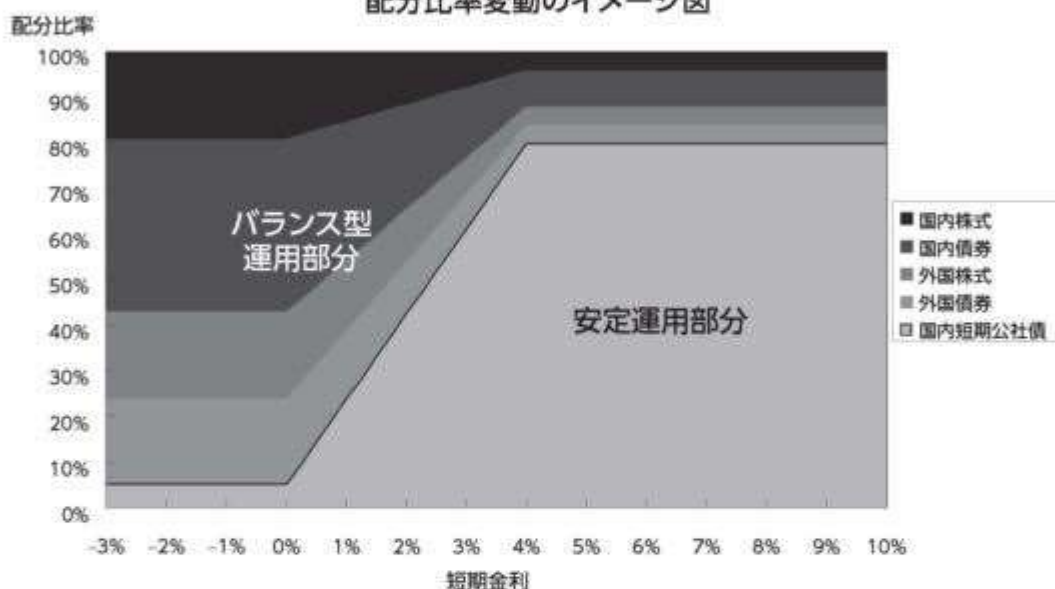
国内株式:三菱UFJ 日本株アクティブマザーファンド ……20%程度
国内債券:日本債券マザーファンド ……………40%程度
外国株式:外国株式マザーファンド ……………20%程度
外国債券:三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド ……20%程度

特色3

わが国の短期金利水準の変動に応じて、バランス型運用部分と安定運用部分への配分比率を変動させるものとし、当該短期金利水準の上昇に伴い安定運用部分への配分比率を引き上げ、当該短期金利水準の低下に伴い安定運用部分への配分比率を引き下げます。なお、安定運用部分への配分比率は以下の範囲内とします。

	安定運用部分への配分比率
下限	短期金利水準が0%以下のとき、純資産総額に対して5%程度
上限	短期金利水準が4%以上のとき、純資産総額に対して80%程度

配分比率変動のイメージ図



※上図は配分比率変動のイメージ図であり、将来の運用状況・成果等を保証するものではありません。

- ・短期金利水準が0%を下回った場合:0%のときの配分比率と同じ
- ・短期金利水準が4%を上回った場合:4%のときの配分比率と同じ

※わが国の短期金利水準は、日銀がホームページ上で公表する「無担保コールO/N物レート(平均)」の月中平均とします。なお、当該指標については今後見直す場合があります。

(注) ファンドは、予め定めた一定のルールに基づき、わが国の短期金利水準の変動に伴いバランス型運用部分と安定運用部分の配分比率が自動的に変動するものであり、期待リターンおよびリスクの予測に基づき資産配分比率の調整を行うものではありません。

また、ファンドのパフォーマンス(運用成果)は、当該配分比率の変動のみによって左右されるものではなく、ファンドが主要投資対象とする各マザーファンドがそれぞれベンチマークを上回る(あるいは中長期的に上回る)ことをめざした運用を行うことによるアクティブ運用成果によっても左右されます。

将来の運用成果等を保証するものではありません。

特色4

実質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。

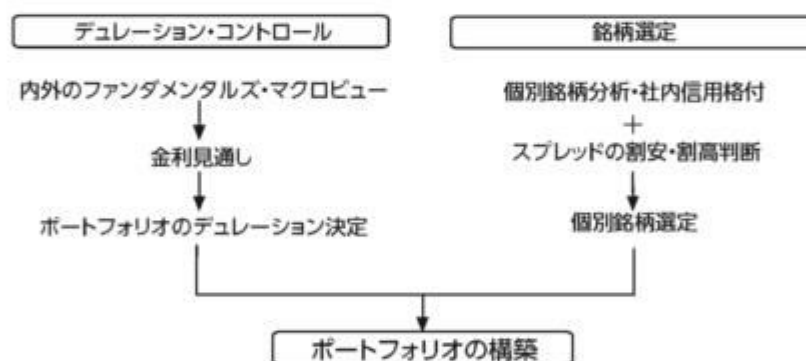
実質的な組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

<各マザーファンドの運用プロセス>

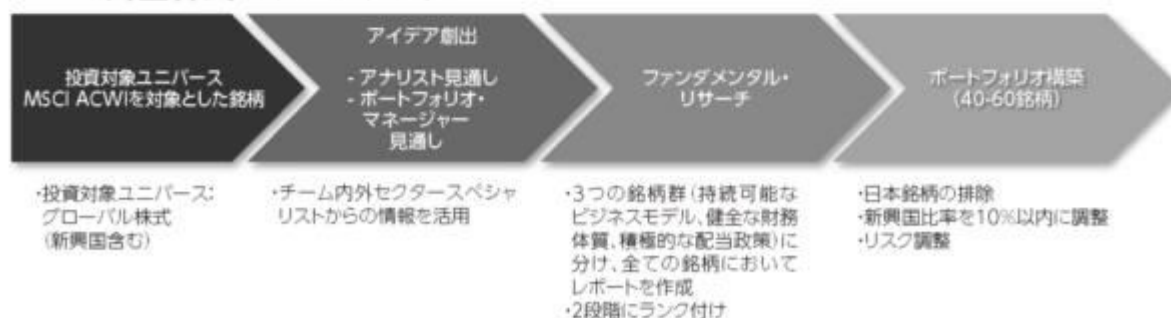
・三菱UFJ 日本株アクティブマザーファンド



・日本債券マザーファンド



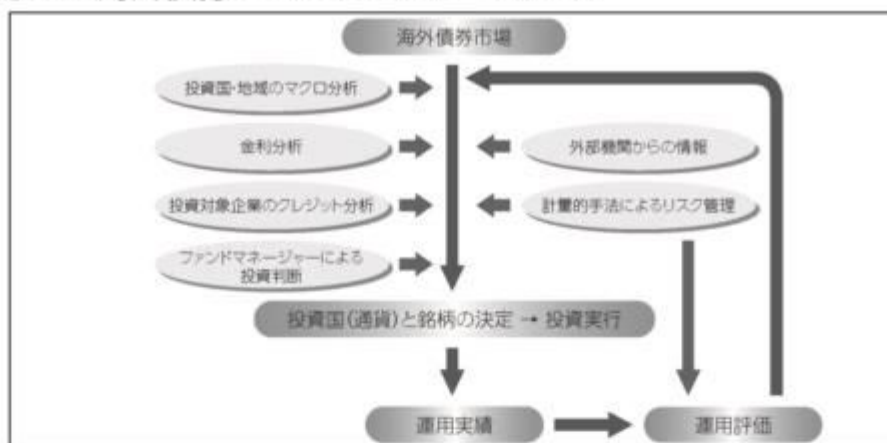
・外国株式マザーファンド



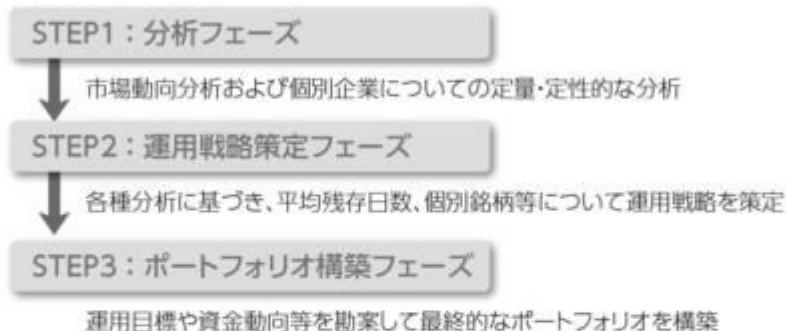
※ MSCI ACWI(MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス)はMSCI Worldに新興国を加えたもので構成されています。

※ 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。

・三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド



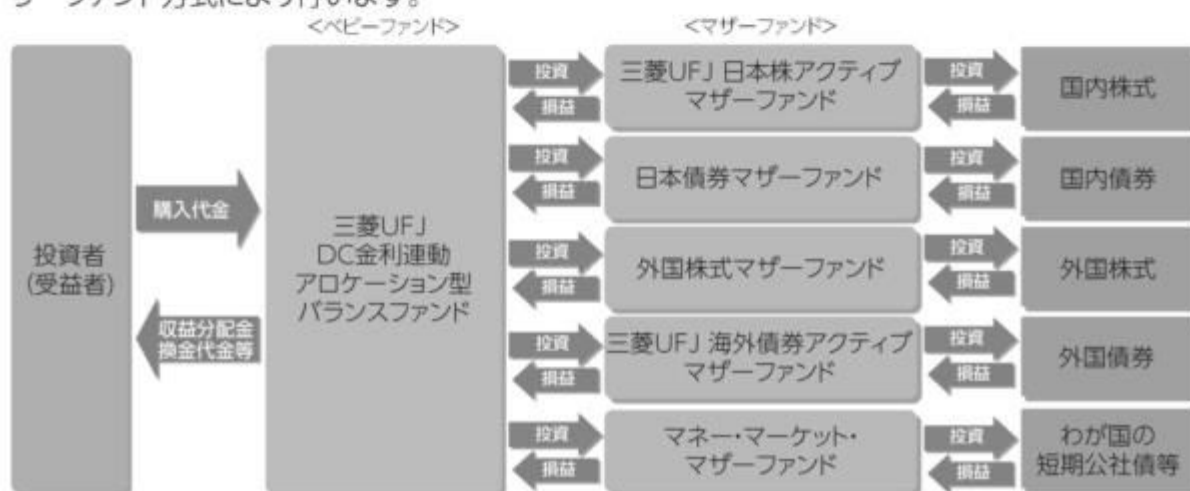
・マネー・マーケット・マザーファンド



- 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。
- ❗ 上記の各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。
- 📄 「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。

■ ファンドの仕組み

運用は主に各マザーファンドへの投資を通じて、内外の株式や債券へ実質的に投資するファミリーファンド方式により行います。



■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50%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10%以下とします。
- ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- ・デリバティブの使用はヘッジ目的に限定します。

■分配方針

- ・年1回の決算時(7月22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。

指数について

TOPIXとは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により東京証券取引所が算出する株価指数です。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。

NOMURA-BPI総合インデックスとは、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。

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

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

また、MSCI Kokusai Index(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。

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

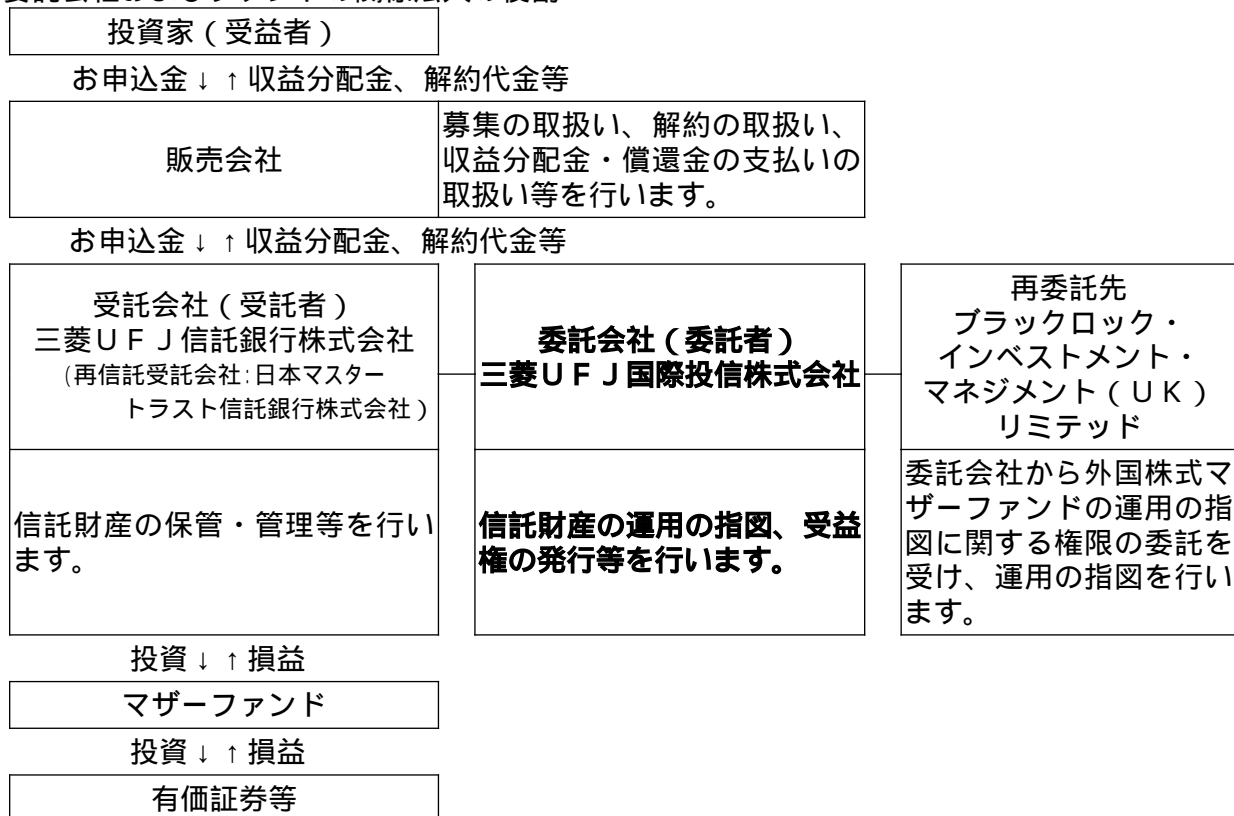
(2)【ファンドの沿革】

2007年8月10日

設定日、信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割



委託会社と関係法人との契約の概要

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

委託会社の概況（2021年7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變更

・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】

三菱ＵＦＪ 日本株アクティブマザーファンド受益証券、日本債券マザーファンド受益証券、外国株式マザーファンド受益証券、三菱ＵＦＪ 海外債券アクティブマザーファンド受益証券およびマネー・マーケット・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、内外の株式・公社債等に直接投資することがあります。

主として、三菱ＵＦＪ 日本株アクティブマザーファンド受益証券、日本債券マザーファンド受益証券、外国株式マザーファンド受益証券、三菱ＵＦＪ 海外債券アクティブマザーファンド受益証券への投資を通じて国内株式、国内債券、外国株式、外国債券に分散投資を行うバランス型運用部分と、マネー・マーケット・マザーファンド受益証券への投資を通じてわが国の短期公社債に投資を行う安定運用部分に、それぞれ投資を行います。

バランス型運用部分における各資産への配分比率は、国内株式20%程度、国内債券40%程度、外国株式20%程度、外国債券20%程度とすることを基本とします。

わが国の短期金利水準の変動に応じて、バランス型運用部分と安定運用部分への配分比率を変動させるものとし、当該短期金利水準の上昇に伴い安定運用部分への配分比率を引き上げ、当該短期金利水準の低下に伴い安定運用部分への配分比率を引き下げます。なお、安定運用部分への配分比率は以下の範囲内とします。

	安定運用部分への配分比率
下限	短期金利水準が０％以下のとき、純資産総額に対して５％程度
上限	短期金利水準が４％以上のとき、純資産総額に対して80％程度

実質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。

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。

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】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- １．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、信託約款に定める次のものに限ります。）
 - ａ．有価証券先物取引等
 - ｂ．スワップ取引
 - ハ．約束手形
 - ニ．金銭債権
- ２．次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ．為替手形

有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、三菱ＵＦＪ国際投信株式会社を委託会社とし、三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社を受託会社とする三菱ＵＦＪ 日本株アクティブマ

ザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド、三菱ＵＦＪ 海外債券アクティブマザーファンドおよびマネー・マーケット・マザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

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

なお、１．の証券または証書ならびに１３．および１９．の証券または証書のうち１．の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、２．から６．までの証券ならびに１６．の証券ならびに１３．および１９．の証券または証書のうち２．から６．までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、１４．および１５．の証券を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

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

- １．預金
- ２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第１４号で定める受益証券発行信託を除きます。）
- ３．コール・ローン
- ４．手形割引市場において売買される手形

５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

６．外国の者に対する権利で５．の権利の性質を有するもの

その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

・外国為替予約取引

<マザーファンドの概要>

三菱ＵＦＪ 日本株アクティブマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、長期的に安定した信託財産の成長をはかることを目標として運用を行います。

（運用方法）

投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

投資態度

ボトムアップ・アプローチを基本としたアクティブ運用により長期的にわが国の株式市場全体（ＴＯＰＩＸ）の動きを上回る運用成果をめざします。

株式への投資にあたっては、運用チームによる会社訪問も含め、自ら徹底的に企業分析を行います。

銘柄選定は、主に以下の観点で行います。

１．オーナーの持ち分としての株主価値の見極め。

２．株主価値を分析する尺度としては、主に企業が事業から継続してキャッシュを生み出す能力を評価。

３．株主価値と株価との関係がバーゲン（株主価値＞株価）と判断される銘柄に投資。

また、株式の組入比率は高位を保つこととし、原則として信託財産総額の50%超を基本とします。

なお、株式以外の資産への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

ただし、資金動向、市況動向、残存信託期間等の事情によっては、上記のような運用が行えない場合があります。

なお、有価証券等の価格変動リスクを回避するため、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、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わが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、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ならびに価格変動リスクを回避するため、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を行うことができます。

（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。）への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、信託財産の純資産総額の20%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は行いません。

有価証券先物取引等は、信託約款の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款の範囲で行います。

金利先渡取引は、信託約款の範囲で行います。

上記は2022年4月4日以降、東京証券取引所の市場区分見直しに伴い、以下の通り変更となります。

（基本方針）

この投資信託は、長期的に安定した信託財産の成長をはかることを目標として運用を行います。

（運用方法）

投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

投資態度

ボトムアップ・アプローチを基本としたアクティブ運用により長期的にＴＯＰＩＸの動きを上回る運用成果をめざします。

株式への投資にあたっては、運用チームによる会社訪問も含め、自ら徹底的に企業分析を行います。

銘柄選定は、主に以下の観点で行います。

- １．オーナーの持ち分としての株主価値の見極め。
- ２．株主価値を分析する尺度としては、主に企業が事業から継続してキャッシュを生み出す能力を評価。
- ３．株主価値と株価との関係がバーゲン（株主価値＞株価）と判断される銘柄に投資。

また、株式の組入比率は高位を保つこととし、原則として信託財産総額の50%超を基本とします。

なお、株式以外の資産への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

ただし、資金動向、市況動向、残存信託期間等の事情によっては、上記のような運用が行えない場合があります。

なお、有価証券等の価格変動リスクを回避するため、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、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わが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、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ならびに価格変動リスクを回避するため、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を行うことができます。

（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。）への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、信託財産の純資産総額の20%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は行いません。

有価証券先物取引等は、信託約款の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款の範囲で行います。

金利先渡取引は、信託約款の範囲で行います。

日本債券マザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、中長期的に信託財産の成長をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

ポートフォリオのデュレーション 調整と銘柄選択による収益獲得をめざして運用を行います。

ポートフォリオのデュレーションはベンチマークの平均を中心に調整します。デュレーション

調整は主としてファンダメンタルズ分析に基づく中期的な金利見通しに沿って行います。

銘柄選択は信用リスクと金利スプレッドを定量的・定性的に分析して行います。

NOMURA - B P I 総合インデックスをベンチマークとし、同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。

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

（投資制限）

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。

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。

外国株式マザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、中長期的に信託財産の成長を目標として運用を行います。

（運用方法）

投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

投資態度

日本を除く世界主要国の株式に投資します。運用にあたってはMSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース）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ます。

企業訪問を含めた独自の調査に基づくアクティブ運用を行います。

超過収益の源泉は、地域配分・銘柄選択の双方におきます。

地域配分は、マクロ経済、市場・業種・個別銘柄の動向等の調査・分析を総合的に勘案し決定します。

銘柄選択の基準としては、経営資源の効率的活用の視点を重視します。

株式の組入比率は、高位を維持することを基本とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

運用の指図に関する権限は、ブラックロック・インベストメント・マネジメント（UK）リミテッドに委託します。

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。

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。

（投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の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5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

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。

三菱ＵＦＪ 海外債券アクティブマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、信託財産の長期的な成長を目標として運用を行います。

（運用方法）**投資対象**

わが国を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

F T S E 世界国債インデックス（除く日本・円ベース）をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。

運用にあたっては、各国のマクロ分析や金利予測に基づいて、カントリーアロケーション、デュレーションおよび残存構成のコントロール、利回り較差に着目した銘柄選択でアクティブに超過収益の獲得を目指します。さらに、ポートフォリオとベンチマークを比較分析することにより、リスクのチェックとコントロールを行います。

組入外貨建資産の為替変動リスクに対するヘッジは原則として行いません。ただし、エクス

ポージャー のコントロール等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

公社債の組入比率は高位（通常の状態では90%以上）を基本とします。

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。

（投資制限）

外貨建資産への投資に制限を設けません。

有価証券先物取引等は信託約款の範囲で行います。

スワップ取引は信託約款の範囲で行います。

金利先渡取引および為替先渡取引は信託約款の範囲で行います。

外国為替予約取引は信託約款の範囲で行います。

エクスポージャーとは、金融資産のうち市場の価格変動リスク・為替変動リスクにさらしている資産の割合のことをいいます。

マネー・マーケット・マザーファンド**（基本方針）**

この投資信託は、安定した収益の確保をめざして安定運用を行います。

（運用方法）**投資対象**

わが国の公社債等を主要投資対象とします。

投資態度

わが国の短期公社債等を中心に投資し、利子等収益の確保を図ります。

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

（投資制限）

株式への投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

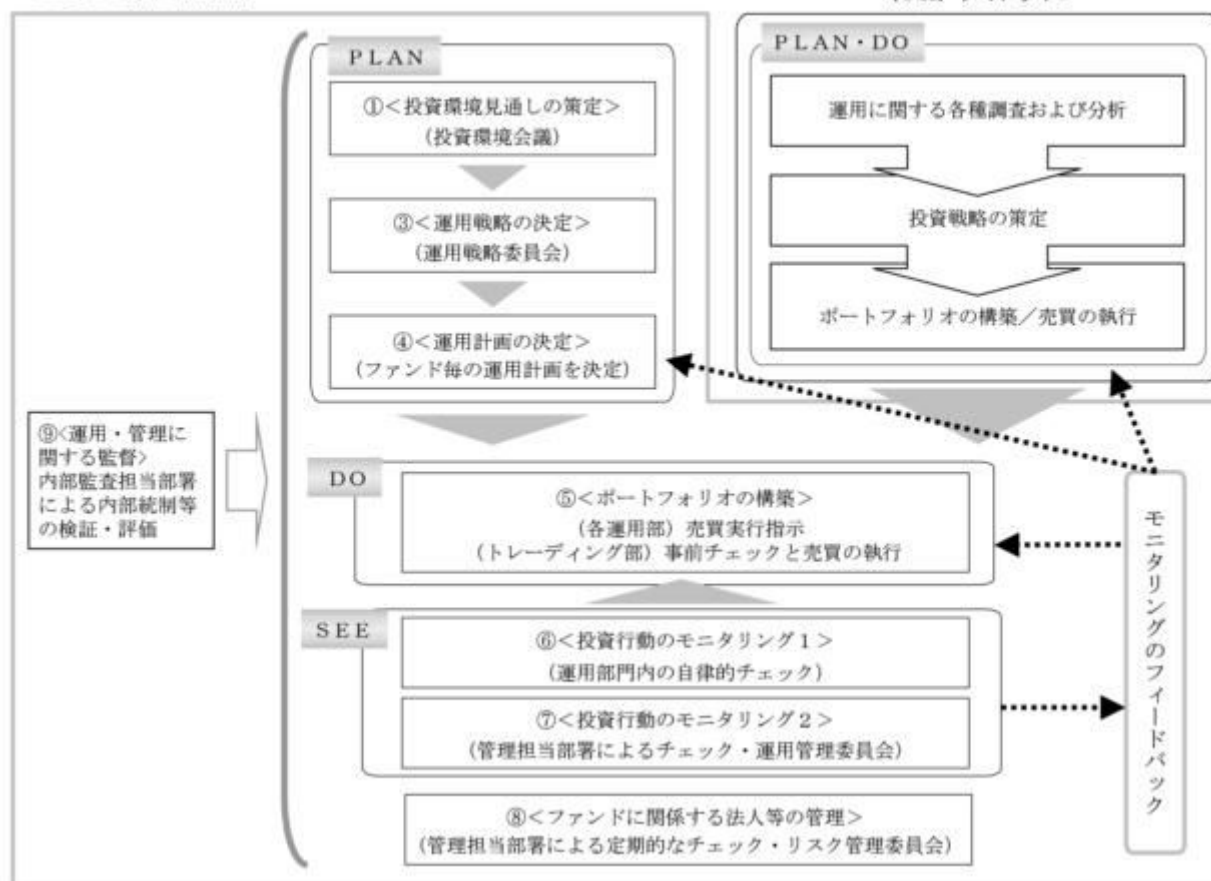
スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

金利先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

（３）【運用体制】

②外国株式マザーファンドの運用の指図に関する権限
 <ブラックロック・インベストメント・マネジメント
 (UK) リミテッド>

<三菱UFJ国際投信>



投資環境見通しの策定

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

運用の指図に関する権限の委託

当ファンドは、三菱UFJ 日本株アクティブマザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド、三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンドおよびマネー・マーケット・マザーファンドを主要投資対象としています。このうち外国株式マザーファンドについては、運用の指図に関する権限を、ブラックロック・インベストメント・マネジメント（UK）リミテッド（「再委託先」といいます。）に委託しています。

再委託先は与えられた運用の指図に関する権限の範囲内で投資戦略を策定し、ポートフォリオの構築を行います。

運用戦略の決定

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

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

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

投資行動のモニタリング1

委託会社の運用部門は、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。

再委託先の投資行動については、各運用部の担当ファンドマネジャーが日々再委託先の運用の適切性を確認しています。

投資行動のモニタリング2

委託会社では、運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）が、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委託会社の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。その内容は更に運用部門から再委託先に還元されます。

ファンドに係る法人等の管理

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

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（10名程度）は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

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

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

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

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

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

（５）【投資制限】

< 信託約款に定められた投資制限 >

株式

a．委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。

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

外貨建資産

a．委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上り等により100分の50を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

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

新株引受権証券および新株予約権証券

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

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

投資信託証券

- a．委託会社は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

同一銘柄の株式等

- a．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該株式の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- c．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- d．c．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

同一銘柄の転換社債等

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

有価証券先物取引等

- a．委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。
1．先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
2．先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受け取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、および組入抵当証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに（2）投資対象 金融商品の指図範囲の1．から4．に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
3．コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、で規定する全オプション取引に係る支払プレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5％を上回らない範囲内とします。
- b．委託会社は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取

引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせてヘッジの対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジの対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジの対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。）との合計額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払プレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつで規定する全オプション取引に係る支払プレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- c. 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに（2）投資対象 金融商品の指図範囲の1. から4. に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに（2）投資対象 金融商品の指図範囲の1. から4. に掲げる金融商品で運用している額（以下2. において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（信託約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払プレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつで規定する全オプション取引に係る支払プレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

スワップ取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下c. において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- d. c. においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- e. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評

価するものとします。

- f．委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

信用取引

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

外国為替予約取引

- a．委託会社は、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）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。
- b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

有価証券の借入れ

有価証券の借入れを行いません。

資金の借入れ

- a．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c．収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

投資する株式等の範囲

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

有価証券の貸付

- a．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
- 1．株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の

時価合計額を超えないものとします。

- ２．公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b．a．に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c．委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

デリバティブ取引等

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

信用リスクの分散規制

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

<その他法令等に定められた投資制限>

- ・同一の法人の発行する株式への投資制限

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

３【投資リスク】

（１）投資リスク

ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けませんが、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。

（主なりスクであり、以下に限定されるものではありません。）

価格変動リスク

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動し、また、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動するため、当ファンドはその影響を受け株式や公社債の価格が下落した場合には基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

為替変動リスク

実質的な主要投資対象である海外の株式や公社債は外貨建資産であり、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。そのため、為替相場が円高方向に進んだ場合には、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信用リスク

信用リスクとは、有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等に、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払いや償還金の支払いが滞る等の債務が不履行となること等をいいます。当ファンドは、信用リスクを伴い、その影響を受けますので、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

流動性リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない、または取引が不可能となるリスクのことを流動性リスクといい、当ファンドはそのリスクを伴います。例えば、組み入れている株式や公社債の売却を十分な流動性の下で行えないときは、市場実勢から期待される価格で売却できない可能性があります。この場合、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

留意事項

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり率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。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。

（２）投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っています。

また、定期的開催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。この内容は運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

トレーディング担当部署

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

コンプライアンス担当部署

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

リスク管理担当部署

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

内部監査担当部署

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

< 流動性リスクに対する管理体制 >

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

* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

〔再委託先の管理体制〕

リスク管理およびコンプライアンスの機能は、運用部門から独立したコンプライアンスおよびオペレーション・リスク管理部門によって実施しております。同部門により、全てのファンドについて投資ガイドライン違反やリスク管理指標からの逸脱がないかどうかのチェックを行なっています。

また、このほかに、投資ガイドラインなどに関するチェックの機能としては、コンプライアンス・スクリーニング・システムにより売買執行前および執行後のモニタリングを行いチェックします。

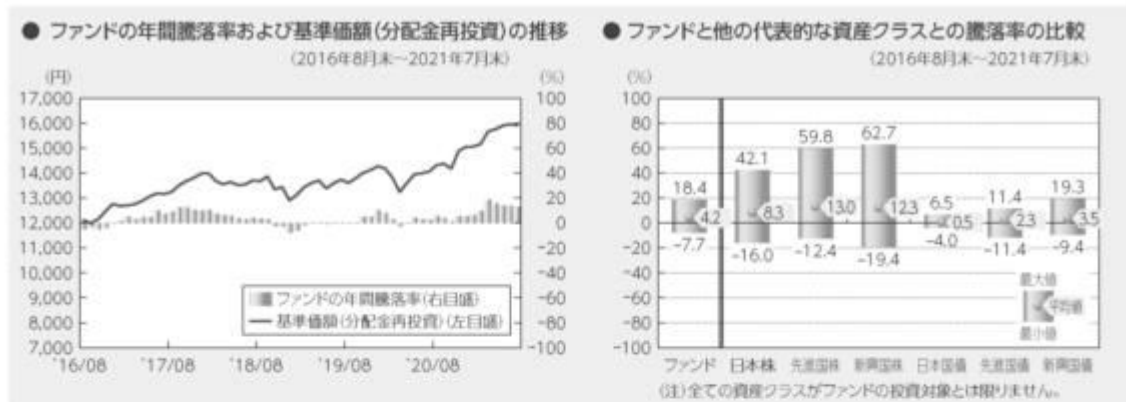
〔委託会社における再委託先に対する確認体制〕

委託会社と再委託先の間で、再委託先がファンド運用コンセプトを維持し、適切に投資リスク管理が図られるよう運用指図権限委託契約として委託内容を定めています。また、委託会社は再委託先に対し定期的に書面による調査等を実施し、投資リスクに対する管理体制の確認を行っています。

また、再委託先からの定期的なデ・タ還元を受け、ファンドのリスクの運営状況の確認を行っているほか、委託会社自身でもモニタリングし、投資リスクを管理しています。

■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。



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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

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

（２）【換金（解約）手数料】

かかりません。

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

（３）【信託報酬等】

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

1万口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額×信託報酬率×（保有日数／365）
上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

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

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.275%	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	0.275%	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	0.05%	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。

外国株式マザーファンドの再委託先が受ける報酬は、当該マザーファンドを投資対象とするファンドの委託会社が、当該ファンドに係る信託報酬のうち委託会社が受ける報酬から、毎年1月22日および7月22日から15営業日以内ならびに信託終了のときに支払われ、その報酬額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、当該マザーファンドの信託財産の純資産総額にマザーファンドの受益権総口数に占める当ファンドに属するマザーファンドの受益権口数の割合を乗じて得た額に年0.45%を乗じて得た金額とします。

（４）【その他の手数料等】

- ・信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、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。

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

上記以外の場合の課税の取扱いは、次の通りです。

個人の受益者に対する課税

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

１．収益分配金の課税

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

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

２．解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

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

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

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

収益分配金について

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

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

ます。

上記は2021年7月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

【三菱ＵＦＪ ＤＣ金利連動アロケーション型バランスファンド】

（１）【投資状況】

令和 3年 7月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	9,988,946,611	99.80
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	19,622,989	0.20
純資産総額		10,008,569,600	100.00

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位 30 銘柄

令和 3年 7月30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	日本債券マザーファンド	2,547,839,072	1.4982	3,817,172,498	1.4989	3,818,955,985	38.16
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	583,359,081	3.2888	1,918,551,346	3.2688	1,906,884,163	19.05
日本	親投資信託受益証券	三菱ＵＦＪ 海外債券アクティブマザーファンド	571,250,296	3.3441	1,910,318,115	3.3326	1,903,748,736	19.02
日本	親投資信託受益証券	三菱ＵＦＪ 日本株アクティブマザーファンド	635,715,592	2.9802	1,894,596,837	2.9532	1,877,395,286	18.76
日本	親投資信託受益証券	マネー・マーケット・マザーファンド	473,347,517	1.0181	481,915,108	1.0182	481,962,441	4.82

（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 7月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.80
合計	99.80

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和3年7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5計算期間末日（平成24年 7月23日）	2,117,400,183	2,117,400,183	8,520	8,520
第6計算期間末日（平成25年 7月22日）	3,259,640,820	3,259,640,820	10,862	10,862
第7計算期間末日（平成26年 7月22日）	4,290,633,492	4,290,633,492	11,637	11,637
第8計算期間末日（平成27年 7月22日）	5,316,803,189	5,316,803,189	13,217	13,217
第9計算期間末日（平成28年 7月22日）	5,370,149,763	5,370,149,763	12,241	12,241
第10計算期間末日（平成29年 7月24日）	6,318,929,248	6,318,929,248	13,252	13,252
第11計算期間末日（平成30年 7月23日）	7,011,814,683	7,011,814,683	13,670	13,670
第12計算期間末日（令和 1年 7月22日）	7,612,126,085	7,612,126,085	13,650	13,650
第13計算期間末日（令和 2年 7月22日）	8,343,391,369	8,343,391,369	14,198	14,198
第14計算期間末日（令和 3年 7月26日）	9,983,968,697	9,983,968,697	15,968	15,968
令和 2年 7月末日	8,328,654,559	—	14,060	—
8月末日	8,576,993,158	—	14,317	—
9月末日	8,660,322,398	—	14,377	—
10月末日	8,589,975,994	—	14,177	—
11月末日	9,027,396,019	—	14,896	—
12月末日	9,196,770,988	—	15,047	—
令和 3年 1月末日	9,196,574,174	—	15,062	—
2月末日	9,214,603,678	—	15,160	—
3月末日	9,704,076,870	—	15,672	—
4月末日	9,769,143,341	—	15,754	—
5月末日	9,905,574,431	—	15,904	—
6月末日	10,012,115,082	—	15,955	—
7月末日	10,008,569,600	—	15,913	—

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第5計算期間	0円
第6計算期間	0円
第7計算期間	0円
第8計算期間	0円
第9計算期間	0円
第10計算期間	0円
第11計算期間	0円
第12計算期間	0円
第13計算期間	0円
第14計算期間	0円

【収益率の推移】

	収益率（％）
第5計算期間	2.96
第6計算期間	27.48
第7計算期間	7.13
第8計算期間	13.57
第9計算期間	7.38
第10計算期間	8.25
第11計算期間	3.15
第12計算期間	0.14
第13計算期間	4.01
第14計算期間	12.46

（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5計算期間	833,407,385	160,036,442	2,485,304,370
第6計算期間	929,756,183	414,103,313	3,000,957,240
第7計算期間	1,076,477,858	390,274,433	3,687,160,665
第8計算期間	1,027,593,242	692,112,098	4,022,641,809
第9計算期間	750,501,178	386,134,577	4,387,008,410
第10計算期間	798,924,527	417,674,596	4,768,258,341
第11計算期間	841,113,021	479,890,083	5,129,481,279

第12計算期間	876,083,668	429,115,781	5,576,449,166
第13計算期間	1,068,167,589	768,154,964	5,876,461,791
第14計算期間	1,155,674,957	779,768,289	6,252,368,459

（参考）

三菱ＵＦＪ 日本株アクティブマザーファンド

投資状況

令和 3年 7月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	日本	40,533,240,750	98.32
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	694,280,355	1.68
純資産総額		41,227,521,105	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 7月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	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	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	160,000	9,644.26	1,543,081,600	9,805.00	1,568,800,000	3.81
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	114,700	10,553.98	1,210,542,403	11,375.00	1,304,712,500	3.16
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	2,162,500	586.60	1,268,522,757	578.50	1,251,006,250	3.03
日本	株式	三井物産	卸売業	408,000	2,421.94	988,154,619	2,499.50	1,019,796,000	2.47
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	22,000	47,583.30	1,046,832,600	44,920.00	988,240,000	2.40
日本	株式	イビデン	電気機器	169,000	5,892.12	995,768,280	5,770.00	975,130,000	2.37
日本	株式	ペイカレント・コンサルティング	サービス業	20,900	35,271.14	737,166,826	43,500.00	909,150,000	2.21
日本	株式	第一三共	医薬品	412,700	2,442.10	1,007,856,642	2,159.50	891,225,650	2.16
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	128,500	7,566.92	972,349,770	6,837.00	878,554,500	2.13
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	82,100	9,785.21	803,365,741	9,610.00	788,981,000	1.91
日本	株式	三菱瓦斯化学	化学	340,000	2,293.76	779,879,768	2,269.00	771,460,000	1.87
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	203,500	3,796.85	772,659,069	3,695.00	751,932,500	1.82
日本	株式	昭和電工	化学	237,600	3,297.58	783,505,440	3,130.00	743,688,000	1.80
日本	株式	ウエストホールディングス	建設業	143,000	3,507.81	501,617,819	4,915.00	702,845,000	1.70
日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	335,900	2,016.71	677,413,903	2,012.00	675,830,800	1.64

日本	株式	日本電産	電気機器	53,600	12,389.44	664,074,324	12,240.00	656,064,000	1.59
日本	株式	オリンパス	精密機器	284,000	2,260.82	642,074,082	2,245.50	637,722,000	1.55
日本	株式	資生堂	化学	84,500	7,688.43	649,673,149	7,286.00	615,667,000	1.49
日本	株式	デンソー	輸送用機器	81,900	7,294.52	597,421,442	7,482.00	612,775,800	1.49
日本	株式	K D D I	情報・通信業	176,100	3,402.30	599,145,566	3,332.00	586,765,200	1.42
日本	株式	三井不動産	不動産業	228,000	2,610.39	595,169,249	2,552.50	581,970,000	1.41
日本	株式	S M C	機械	8,900	63,038.52	561,042,891	64,800.00	576,720,000	1.40
日本	株式	朝日インテック	精密機器	192,000	2,533.00	486,336,819	2,958.00	567,936,000	1.38
日本	株式	豊田自動織機	輸送用機器	62,100	9,366.21	581,641,953	9,140.00	567,594,000	1.38
日本	株式	S C R E E Nホールディングス	電気機器	57,000	10,533.82	600,427,740	9,850.00	561,450,000	1.36
日本	株式	小糸製作所	電気機器	83,400	6,526.49	544,309,977	6,660.00	555,444,000	1.35
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	99,700	4,921.53	490,676,789	5,210.00	519,437,000	1.26
日本	株式	豊田合成	輸送用機器	201,500	2,612.84	526,488,961	2,563.00	516,444,500	1.25
日本	株式	東京応化工業	化学	72,400	6,813.93	493,328,671	7,070.00	511,868,000	1.24
日本	株式	C K D	機械	227,800	2,318.95	528,257,873	2,178.00	496,148,400	1.20

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 3年 7月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	建設業	3.41
	食料品	1.40
	化学	7.92
	医薬品	4.39
	ガラス・土石製品	1.46
	非鉄金属	1.58
	機械	4.68
	電気機器	21.14
	輸送用機器	10.20
	精密機器	3.48
	その他製品	1.96
	陸運業	2.13
	海運業	0.85
	情報・通信業	11.87
	卸売業	3.25
	小売業	4.16
	銀行業	5.60
	証券、商品先物取引業	0.75
	保険業	2.90
	不動産業	1.41
	サービス業	3.77

小計	98.32
合計	98.32

（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。

日本債券マザーファンド

投資状況

令和 3年 7月30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	5,350,159,200	59.82
社債券	日本	3,026,823,000	33.84
	イギリス	100,365,000	1.12
	スイス	100,340,000	1.12
	小計	3,227,528,000	36.09
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	365,810,260	4.09
純資産総額		8,943,497,460	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 7月30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）	210,000,000	101.23	212,601,900	101.19	212,499,000	0.100000	2030/9/20	2.38
日本	社債券	第16回イオンフィ ナンシャルサービス	200,000,000	100.02	200,052,000	100.01	200,030,000	0.270000	2025/6/24	2.24
日本	社債券	第6回マラヤン・バ ンキング	200,000,000	99.84	199,682,000	99.84	199,686,000	0.224000	2023/2/13	2.23
日本	国債証券	第67回利付国債 （30年）	150,000,000	99.38	149,082,000	99.75	149,631,000	0.600000	2050/6/20	1.67

日本	国債証券	第１６６回利付国債 （２０年）	130,000,000	106.87	138,934,900	106.86	138,925,800	0.700000	2038/9/20	1.55
日本	国債証券	第１４６回利付国債 （２０年）	110,000,000	119.35	131,285,000	119.25	131,178,300	1.700000	2033/9/20	1.47
日本	国債証券	第１２８回利付国債 （２０年）	110,000,000	118.68	130,557,900	118.60	130,460,000	1.900000	2031/6/20	1.46
日本	国債証券	第３５４回利付国債 （１０年）	120,000,000	101.65	121,989,600	101.57	121,891,200	0.100000	2029/3/20	1.36
日本	国債証券	第１４３回利付国債 （２０年）	100,000,000	117.60	117,607,000	117.51	117,514,000	1.600000	2033/3/20	1.31
日本	国債証券	第１４９回利付国債 （２０年）	100,000,000	117.52	117,528,000	117.50	117,506,000	1.500000	2034/6/20	1.31
日本	国債証券	第５８回利付国債 （３０年）	110,000,000	105.81	116,391,000	106.17	116,793,600	0.800000	2048/3/20	1.31
日本	社債券	第１３回住友信託銀行 （劣後特約付）	100,000,000	109.54	109,543,000	109.54	109,541,000	2.341000	2026/6/15	1.22
日本	社債券	第１４回住友信託銀行 劣後特約付	100,000,000	109.16	109,168,000	109.17	109,171,000	2.159000	2026/9/28	1.22
日本	国債証券	第６０回利付国債 （３０年）	100,000,000	108.14	108,140,000	108.51	108,519,000	0.900000	2048/9/20	1.21
日本	国債証券	第１６２回利付国債 （２０年）	100,000,000	105.51	105,515,000	105.50	105,509,000	0.600000	2037/9/20	1.18
日本	国債証券	第１３６回利付国債 （２０年）	90,000,000	116.53	104,884,200	116.45	104,805,900	1.600000	2032/3/20	1.17
日本	国債証券	第１５３回利付国債 （２０年）	90,000,000	115.49	103,949,100	115.56	104,004,000	1.300000	2035/6/20	1.16
日本	国債証券	第１５４回利付国債 （２０年）	90,000,000	114.23	102,808,800	114.29	102,865,500	1.200000	2035/9/20	1.15
日本	国債証券	第１５２回利付国債 （２０年）	90,000,000	114.04	102,636,900	114.02	102,621,600	1.200000	2035/3/20	1.15
日本	社債券	第１回パークレイズ・ ビーエルシー期限前償還条項付	100,000,000	101.69	101,695,000	101.71	101,714,000	1.232000	2024/9/25	1.14
日本	社債券	第１回みずほフィナン シャルグループ	100,000,000	101.33	101,338,000	101.33	101,339,000	0.950000	2024/7/16	1.13
日本	社債券	第２０回みずほ銀行 （劣後特約付）	100,000,000	101.05	101,050,000	101.04	101,045,000	1.490000	2022/6/3	1.13
日本	社債券	第１６回Ｚホール ディングス	100,000,000	100.98	100,983,000	100.96	100,968,000	0.600000	2025/6/11	1.13
日本	社債券	第３回ソシエテジェ ネラル円貨社債（２０ １８）	100,000,000	100.72	100,721,000	100.71	100,717,000	0.804000	2023/10/12	1.13
日本	国債証券	第１５５回利付国債 （２０年）	90,000,000	111.50	100,358,100	111.57	100,417,500	1.000000	2035/12/20	1.12
日本	社債券	第１６回エヌ・ティ・ ティ・ファイナンス	100,000,000	100.39	100,399,000	100.38	100,389,000	0.180000	2025/12/19	1.12
日本	社債券	第１４回セブン＆ア イ・ホールディングス	100,000,000	100.39	100,399,000	100.38	100,388,000	0.190000	2025/12/19	1.12
日本	社債券	第８回ソフトバンク	100,000,000	100.39	100,393,000	100.38	100,382,000	0.350000	2025/12/3	1.12
イギリス	社債券	NATWEST MARKETS	100,000,000	100.37	100,378,000	100.36	100,365,000	0.737000	2022/7/4	1.12
スイス	社債券	UBS GROUP FUNDING （SWITZERLAND）	100,000,000	100.25	100,259,000	100.34	100,340,000	0.719000	2024/11/8	1.12

（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 7月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	59.82
社債券	36.09
合計	95.91

（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。

外国株式マザーファンド

投資状況

令和 3年 7月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	アメリカ	7,324,914,601	54.69
	イギリス	2,713,882,583	20.26
	フランス	1,349,100,488	10.07
	台湾	418,434,258	3.12
	香港	302,700,965	2.26
	デンマーク	272,588,974	2.04
	スペイン	198,199,105	1.48
	メキシコ	135,715,110	1.01
	シンガポール	129,986,394	0.97
	オーストラリア	97,337,591	0.73
	小計	12,942,860,069	96.63
投資証券	アメリカ	276,640,061	2.07
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	174,650,703	1.30
純資産総額		13,394,150,833	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 7月30日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	業種	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 (%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	17,119	31,715.96	542,945,661	31,368.88	537,003,942	4.01
イギリス	株式	RELX PLC	商業・専門サービス	160,883	3,162.97	508,868,762	3,235.83	520,590,955	3.89
フランス	株式	SANOFI	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	42,641	11,458.78	488,614,166	11,257.11	480,014,734	3.58
アメリカ	株式	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	各種金融	31,733	13,287.70	421,658,787	13,228.58	419,782,586	3.13
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	183,000	2,294.37	419,869,710	2,286.52	418,434,258	3.12
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	9,017	45,733.97	412,383,235	45,118.63	406,834,770	3.04
アメリカ	株式	TEXAS INSTRUMENTS INC	半導体・半導体製造装置	19,472	20,490.43	398,989,748	20,784.48	404,715,525	3.02
アメリカ	株式	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	ソフトウェア・サービス	24,631	16,295.39	401,371,916	16,382.98	403,529,395	3.01
アメリカ	株式	TELUS CORP	電気通信サービス	157,022	2,409.87	378,403,376	2,417.53	379,606,840	2.83
アメリカ	株式	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	50,327	7,482.54	376,574,123	7,461.74	375,527,165	2.80
イギリス	株式	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	家庭用品・パーソナル用品	43,890	9,568.88	419,978,424	8,511.78	373,582,340	2.79
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	13,742	27,265.19	374,678,376	27,144.76	373,023,303	2.78
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	27,940	12,940.62	361,561,010	13,015.07	363,641,232	2.71
イギリス	株式	DIAGEO PLC	食品・飲料・タバコ	64,242	5,355.00	344,016,025	5,407.70	347,401,720	2.59
イギリス	株式	FERGUSON PLC	資本財	22,411	15,879.40	355,873,279	15,413.48	345,431,590	2.58
イギリス	株式	PRUDENTIAL PLC	保険	158,587	2,084.41	330,560,360	2,099.68	332,982,935	2.49
イギリス	株式	ASTRAZENECA PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	25,796	12,954.04	334,162,622	12,643.94	326,163,210	2.44
イギリス	株式	UNILEVER PLC	家庭用品・パーソナル用品	51,490	6,306.43	324,718,168	6,279.10	323,311,302	2.41
アメリカ	株式	INTUIT INC	ソフトウェア・サービス	5,002	57,857.80	289,404,719	57,538.08	287,805,526	2.15
アメリカ	株式	CITIZENS FINANCIAL GROUP	銀行	61,133	4,777.04	292,035,318	4,691.64	286,814,425	2.14
アメリカ	株式	HASBRO INC	耐久消費財・アパレル	25,468	10,117.97	257,684,483	11,002.65	280,215,493	2.09
アメリカ	投資証券	AMERICAN TOWER CORP	—	8,928	31,233.11	278,849,271	30,985.66	276,640,061	2.07

デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	27,252	9,985.04	272,112,337	10,002.53	272,588,974	2.04
アメリカ	株式	ASSURANT INC	保険	15,354	16,973.13	260,605,588	17,293.94	265,531,239	1.98
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	39,080	6,389.83	249,714,806	6,362.46	248,645,089	1.86
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	耐久消費財・アパレル	2,774	87,694.13	243,263,544	88,995.24	246,872,796	1.84
アメリカ	株式	OTIS WORLDWIDE CORP	資本財	24,383	9,692.05	236,321,372	9,730.37	237,255,765	1.77
アメリカ	株式	M & T BANK CORP	銀行	15,752	14,160.34	223,053,703	14,806.33	233,229,353	1.74
フランス	株式	SCHNEIDER ELECTRIC SE	資本財	12,062	18,238.81	219,996,645	18,059.26	217,830,891	1.63
アメリカ	株式	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	家庭用品・パーソナル用品	5,702	36,520.38	208,239,261	36,524.76	208,264,233	1.55

（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 7月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	エネルギー	0.84
	資本財	9.89
	商業・専門サービス	3.89
	耐久消費財・アパレル	6.95
	メディア・娯楽	1.86
	食品・生活必需品小売り	1.01
	食品・飲料・タバコ	5.36
	家庭用品・パーソナル用品	6.76
	ヘルスケア機器・サービス	5.25
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	13.57
	銀行	4.85
	各種金融	4.68
	保険	5.91
	ソフトウェア・サービス	14.31
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.53
	電気通信サービス	2.83
	公益事業	0.99
	半導体・半導体製造装置	6.15
	小計	96.63
投資証券	—	2.07
合計		98.70

（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。

三菱ＵＦＪ 海外債券アクティブマザーファンド

投資状況

令和 3年 7月30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	20,980,306,558	43.52
	イタリア	5,993,679,976	12.43
	スペイン	4,897,927,937	10.16
	イギリス	3,345,145,702	6.94
	フランス	2,082,914,909	4.32
	カナダ	1,694,738,079	3.52
	ドイツ	1,336,400,769	2.77
	ベルギー	866,293,289	1.80
	オランダ	588,471,448	1.22
	メキシコ	441,061,631	0.91
	アイルランド	404,862,102	0.84
	ポーランド	325,584,063	0.68
	マレーシア	303,717,062	0.63
	シンガポール	205,117,050	0.43
	スウェーデン	187,691,089	0.39
	イスラエル	169,695,094	0.35
	ノルウェー	128,386,093	0.27
	オーストラリア	91,413,439	0.19
	小計	44,043,406,290	91.36
特殊債券	アメリカ	1,059,572,372	2.20
	イギリス	422,249,109	0.88
	オーストラリア	404,460,806	0.84
	小計	1,886,282,287	3.91
社債券	アメリカ	583,463,010	1.21
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	1,695,256,492	3.52
純資産総額		48,208,408,079	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 7月30日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 221031	35,000,000	11,243.90	3,935,365,710	11,208.61	3,923,013,867	2.000000	2022/10/31	8.14
アメリカ	国債証券	1.75 T-NOTE 230515	31,000,000	11,324.19	3,510,501,742	11,258.65	3,490,181,936	1.750000	2023/5/15	7.24
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 250815	19,000,000	11,687.01	2,220,532,646	11,573.86	2,199,033,940	2.000000	2025/8/15	4.56
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 260215	19,000,000	11,610.66	2,206,026,759	11,423.74	2,170,510,940	1.625000	2026/2/15	4.50
イタリア	国債証券	1.75 ITALY GOVT 240701	13,000,000	13,939.12	1,812,086,468	13,776.98	1,791,007,867	1.750000	2024/7/1	3.72
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 310215	15,000,000	10,828.83	1,624,324,866	10,815.98	1,622,398,011	1.125000	2031/2/15	3.37
スペイン	国債証券	1.95 SPAIN GOVT 260430	11,000,000	14,701.12	1,617,124,179	14,476.65	1,592,431,513	1.950000	2026/4/30	3.30
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 240215	13,500,000	11,840.31	1,598,442,799	11,639.72	1,571,363,269	2.750000	2024/2/15	3.26
アメリカ	国債証券	1.875 T-BOND 510215	13,500,000	10,198.74	1,376,830,336	10,808.71	1,459,176,652	1.875000	2051/2/15	3.03
スペイン	国債証券	2.35 SPAIN GOVT 330730	9,000,000	16,524.29	1,487,186,926	15,999.26	1,439,933,615	2.350000	2033/7/30	2.99
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 271115	12,000,000	11,715.85	1,405,902,923	11,835.61	1,420,273,485	2.250000	2027/11/15	2.95
イタリア	国債証券	0 ITALY GOVT 260401	10,000,000	12,862.54	1,286,254,449	13,048.31	1,304,831,034	0.000000	2026/4/1	2.71
イギリス	国債証券	1.25 GILT 411022	7,900,000	16,439.78	1,298,743,217	16,030.62	1,266,419,152	1.250000	2041/10/22	2.63
イギリス	国債証券	4.75 GILT 301207	5,500,000	22,101.31	1,215,572,424	21,091.82	1,160,050,641	4.750000	2030/12/7	2.41
カナダ	国債証券	2.25 CAN GOVT 290601	11,500,000	9,875.47	1,135,679,406	9,583.70	1,102,125,976	2.250000	2029/6/1	2.29
アメリカ	特殊債券	0.875 IBRD 300514	10,000,000	10,858.48	1,085,848,450	10,595.72	1,059,572,372	0.875000	2030/5/14	2.20
フランス	国債証券	1.25 O.A.T 360525	7,000,000	15,743.31	1,102,031,700	15,023.80	1,051,666,119	1.250000	2036/5/25	2.18
アメリカ	国債証券	3.125 T-BOND 430215	7,500,000	13,815.49	1,036,162,464	13,428.77	1,007,158,306	3.125000	2043/2/15	2.09
スペイン	国債証券	5.9 SPAIN GOVT 260730	5,000,000	17,695.76	884,788,334	17,142.80	857,140,349	5.900000	2026/7/30	1.78
イタリア	国債証券	2.45 ITALY GOVT 500901	5,500,000	15,266.23	839,642,766	15,539.02	854,646,336	2.450000	2050/9/1	1.77
アメリカ	国債証券	4.75 T-BOND 410215	5,000,000	17,586.83	879,341,562	16,433.76	821,688,234	4.750000	2041/2/15	1.70
ベルギー	国債証券	0.9 BEL GOVT 290622	4,800,000	14,589.23	700,283,247	14,322.11	687,461,687	0.900000	2029/6/22	1.43
スペイン	国債証券	0.5 SPAIN GOVT 300430	4,500,000	13,493.27	607,197,349	13,498.11	607,415,348	0.500000	2030/4/30	1.26
アメリカ	国債証券	3.875 T-BOND 400815	4,000,000	15,773.12	630,925,176	14,741.80	589,672,081	3.875000	2040/8/15	1.22
イギリス	国債証券	4.25 GILT 551207	1,900,000	32,026.40	608,501,770	30,079.97	571,519,460	4.250000	2055/12/7	1.19
イタリア	国債証券	4.75 ITALY GOVT 280901	3,300,000	17,416.52	574,745,312	17,110.47	564,645,621	4.750000	2028/9/1	1.17
ドイツ	国債証券	4.75 BUND 400704	2,200,000	25,182.97	554,025,425	25,530.60	561,673,213	4.750000	2040/7/4	1.17

オランダ	国債証券	0.25 NETH GOVT 290715	4,000,000	13,980.31	559,212,780	13,770.90	550,836,298	0.250000	2029/7/15	1.14
フランス	国債証券	0 O.A.T 301125	4,000,000	13,428.13	537,125,307	13,247.50	529,900,038	0.000000	2030/11/25	1.10
ドイツ	国債証券	0.25 BUND 280815	3,700,000	14,015.03	518,556,215	13,871.96	513,262,664	0.250000	2028/8/15	1.06

（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 7月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	91.36
特殊債券	3.91
社債券	1.21
合計	96.48

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

マネー・マーケット・マザーファンド

投資状況

令和 3年 7月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国 / 地域	時価合計	投資比率（％）
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	1,313,778,956	100.00
純資産総額		1,313,778,956	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

該当事項はありません。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

該当事項はありません。

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。

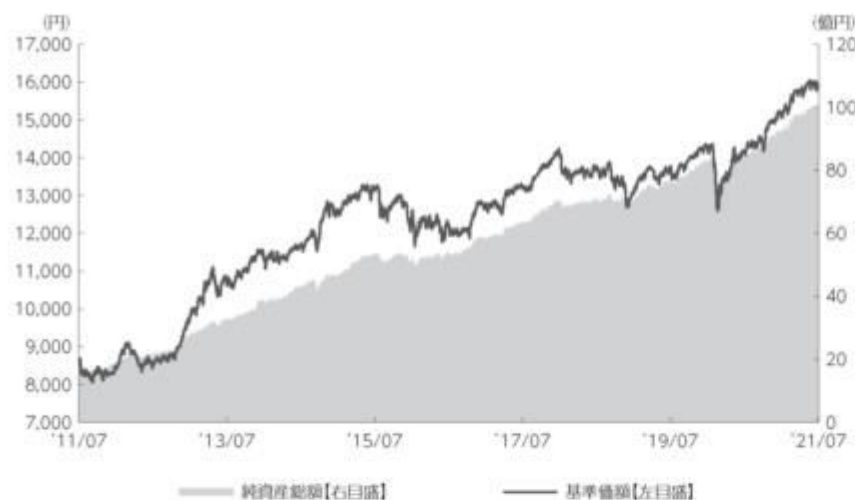
参考情報



運用実績

2021年7月30日現在

■基準価額・純資産の推移 2011年7月29日～2021年7月30日



■基準価額・純資産

基準価額	15,913円
純資産総額	100.0億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2021年 7月	0円
2020年 7月	0円
2019年 7月	0円
2018年 7月	0円
2017年 7月	0円
2016年 7月	0円
設定来累計	0円

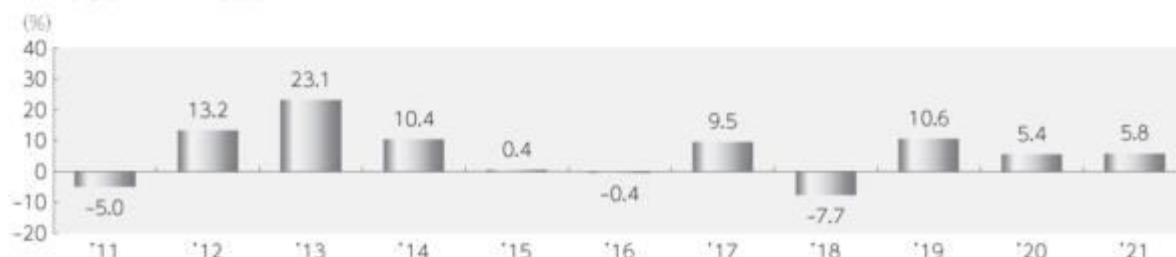
●分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

資産別構成	比率	組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	種類	業種／種別	国・地域	比率
国内株式	18.4%	1 円	62.1%	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.8%
国内債券	36.6%	2 アメリカドル	20.3%	RELX PLC	株式	商業・専門サービス	イギリス	0.7%
外国株式	18.8%	3 ユーロ	9.8%	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	日本	0.7%
外国債券	18.4%	4 イギリスポンド	4.2%	SANOFI	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	フランス	0.7%
		5 カナダドル	0.7%	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	株式	各種金融	アメリカ	0.6%
		6 ニュー台湾ドル	0.6%	2 T-NOTE 221031	債券	国債	アメリカ	1.5%
		7 香港ドル	0.4%	1.75 T-NOTE 230515	債券	国債	アメリカ	1.4%
コールローン他 （負債控除後）	7.8%	8 デンマーククローネ	0.4%	第360回利付国債（10年）	債券	国債	日本	0.9%
合計	100.0%	9 メキシコペソ	0.4%	2 T-NOTE 250815	債券	国債	アメリカ	0.9%
		10 オーストラリアドル	0.3%	1.625 T-NOTE 260215	債券	国債	アメリカ	0.9%

- 各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率（小数点第二位四捨五入）
- 投資信託証券（リートを含む）の組入れがある場合、株式に含めて表示
- コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。
- 国内株式の業種は、東京証券取引所の33業種分類によるもの
- 外国株式の業種は、GICS（世界産業分類基準）によるもの。Global Industry Classification Standard（“GICS”）は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。
- 「国・地域」は原則、発行通貨ベースで分類しています。（ただし、発行通貨がユーロの場合は発行地）

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2021年は年初から7月30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】

申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

申込単位

1円以上1円単位

申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

申込価額の照会方法

申込価額は、販売会社にてご確認ください。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

申込手数料

ありません。

申込方法

取得申込者は、販売会社取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

申込受付時間

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

取得申込みの受付の中止および取消し

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

申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

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

解約単位

1 口単位

解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

信託財産留保額

ありません。

解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

支払開始日

解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。

解約請求受付時間

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

解約請求受付の中止および取消し

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

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

3 【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

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

（資産の評価方法）

・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券

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

・ 転換社債 / 転換社債型新株予約権付社債

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

・ 公社債等

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

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

・ マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・ 投資信託証券（上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・ 外貨建資産

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

・ 外国為替予約取引

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

・ 市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限（2007年8月10日設定）

ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。

（４）【計算期間】

毎年7月23日から翌年7月22日まで

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

（５）【その他】

ファンドの償還条件等

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

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

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

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

信託約款の変更

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ができます。委託会社は、信託約款を変更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。

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

ファンドの償還等に関する開示方法

委託会社は、ファンドの任意償還または信託約款の変更のうち重大な内容の変更を行おうとする場合、あらかじめその旨およびその内容を公告し、かつ、原則としてこれらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。この公告および書面には、原則として、受益者で異議のあるものは一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。

異議申立ておよび反対者の買取請求権

受益者は、委託会社がファンドの任意償還または信託約款について重大な内容の変更を行おうとする場合、原則として、一定の期間（1ヵ月以上）内に委託会社に対して異議を述べるすることができます。異議を述べた受益者は、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。なお、一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、ファンドの償還または信託約款の変更を行いません。その場合、償還しない旨または信託約款を変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、原則として、これらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。

関係法人との契約の更改

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

委託会社と再委託先との間で締結された契約は、契約締結の日から1年間とし、期間満了の6ヵ月前までに相手方に対し書面による契約終了の申し出がない限り、1年間自動的に延長されるものとし、その後もまた同様とします。

運用報告書

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

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。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。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

信託事務の再信託

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

公告

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

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

（１）収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に应じて受領する権利を有します。

収益分配金は、「累積投資契約」に基づいて、決算日の基準価額により自動的に無手数料で全額再投資されます。

（２）償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に应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7月23日から令和3年7月26日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三菱ＵＦＪ ＤＣ金利連動アロケーション型バランスファンド】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第13期 [令和 2年 7月22日現在]	第14期 [令和 3年 7月26日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	44,275,183	57,668,305
親投資信託受益証券	8,327,053,784	9,961,732,192
未収入金	150,568	834,078
流動資産合計	8,371,479,535	10,020,234,575
資産合計	8,371,479,535	10,020,234,575
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,629,010	3,701,641
未払受託者報酬	2,191,787	2,697,505
未払委託者報酬	24,109,588	29,672,515
未払利息	35	57
その他未払費用	157,746	194,160
流動負債合計	28,088,166	36,265,878
負債合計	28,088,166	36,265,878
純資産の部		
元本等		
元本	5,876,461,791	6,252,368,459
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,466,929,578	3,731,600,238
（分配準備積立金）	1,249,665,427	2,103,508,977
元本等合計	8,343,391,369	9,983,968,697
純資産合計	8,343,391,369	9,983,968,697
負債純資産合計	8,371,479,535	10,020,234,575

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期 自 令和 1年 7月23日 至 令和 2年 7月22日	第14期 自 令和 2年 7月23日 至 令和 3年 7月26日
営業収益		
受取利息	309	54
有価証券売買等損益	363,771,291	1,141,265,038
営業収益合計	363,771,600	1,141,265,092
営業費用		
支払利息	13,685	7,677
受託者報酬	4,361,228	5,131,199
委託者報酬	47,973,351	56,443,074
その他費用	313,886	369,324
営業費用合計	52,662,150	61,951,274
営業利益又は営業損失（ ）	311,109,450	1,079,313,818
経常利益又は経常損失（ ）	311,109,450	1,079,313,818
当期純利益又は当期純損失（ ）	311,109,450	1,079,313,818
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（ ）	9,154,604	75,691,024
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,035,676,919	2,466,929,578
剰余金増加額又は欠損金減少額	411,411,481	592,926,464
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	411,411,481	592,926,464
剰余金減少額又は欠損金増加額	282,113,668	331,878,598
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	282,113,668	331,878,598
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,466,929,578	3,731,600,238

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
２．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年7月22日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は令和 2年 7月23日から令和 3年 7月26日までとなっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

第14期〔令和 3年 7月26日現在〕

当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当計算期間の翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

	第13期 [令和 2年 7月22日現在]	第14期 [令和 3年 7月26日現在]
１．期首元本額	5,576,449,166円	5,876,461,791円
期中追加設定元本額	1,068,167,589円	1,155,674,957円
期中一部解約元本額	768,154,964円	779,768,289円
２．受益権の総数	5,876,461,791口	6,252,368,459口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第13期 自 令和 1年 7月23日 至 令和 2年 7月22日	第14期 自 令和 2年 7月23日 至 令和 3年 7月26日																		
1.運用に係る権限を委託するための費用 「外国株式マザーファンド」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、親投資信託の純資産総額に親投資信託の受益権総口数に占める当投資信託に属する受益権口数の割合に乗じて得た額に対し年10,000分の45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。	1.運用に係る権限を委託するための費用 「外国株式マザーファンド」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、親投資信託の純資産総額に親投資信託の受益権総口数に占める当投資信託に属する受益権口数の割合に乗じて得た額に対し年10,000分の45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	2.分配金の計算過程																		
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>117,864,918円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>122,076,697円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	117,864,918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	122,076,697円	<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>134,710,376円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>868,912,418円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	134,710,376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	868,912,418円
項目																			
費用控除後の配当等収益額	A	117,864,918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	122,076,697円																	
項目																			
費用控除後の配当等収益額	A	134,710,376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	868,912,418円																	

第13期 自 令和 1年 7月23日 至 令和 2年 7月22日				第14期 自 令和 2年 7月23日 至 令和 3年 7月26日			
	収益調整金額	C	1,905,923,128円		収益調整金額	C	2,259,114,632円
	分配準備積立金額	D	1,009,723,812円		分配準備積立金額	D	1,099,886,183円
	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,155,588,555円		当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,362,623,609円
	当ファンドの期末残存口数	F	5,876,461,791口		当ファンドの期末残存口数	F	6,252,368,459口
	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	5,369円		1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	6,977円
	1万口当たり分配金額	H	—円		1万口当たり分配金額	H	—円
	収益分配金金額	I=F*H/10,000	—円		収益分配金金額	I=F*H/10,000	—円

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	第13期 自 令和 1年 7月23日 至 令和 2年 7月22日	第14期 自 令和 2年 7月23日 至 令和 3年 7月26日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第13期 [令和 2年 7月22日現在]	第14期 [令和 3年 7月26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記) に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
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13期 [令和 2年 7月22日現在]	第14期 [令和 3年 7月26日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	338,190,179	1,039,272,669
合計	338,190,179	1,039,272,669

（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13期 [令和 2年 7月22日現在]	第14期 [令和 3年 7月26日現在]
1口当たり純資産額	1.4198円	1.5968円
(1万口当たり純資産額)	(14,198円)	(15,968円)

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	三菱ＵＦＪ 日本株アクティブマザーファンド	626,687,242	1,867,841,324	
	三菱ＵＦＪ 海外債券アクティブマザーファンド	569,311,778	1,903,892,447	
	日本債券マザーファンド	2,531,817,646	3,793,422,379	
	外国株式マザーファンド	583,605,967	1,919,363,304	
	マネー・マーケット・マザーファンド	468,682,713	477,212,738	
合計		4,780,105,346	9,961,732,192	

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。

三菱ＵＦＪ 日本株アクティブマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
[令和 3年 7月26日現在]	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	680,679,181
株式	40,860,180,150
未収入金	53,513,603
未収配当金	17,983,344
流動資産合計	41,612,356,278
資産合計	41,612,356,278
負債の部	
流動負債	
未払金	103,939,411
未払解約金	18,281,960
未払利息	675
流動負債合計	122,222,046
負債合計	122,222,046
純資産の部	
元本等	
元本	13,920,426,632
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	27,569,707,600
元本等合計	41,490,134,232
純資産合計	41,490,134,232
負債純資産合計	41,612,356,278

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	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
--------------------	---

(重要な会計上の見積りに関する注記)

[令和 3年 7月26日現在]

当期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当期間の翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

[令和 3年 7月26日現在]	
1. 期首	令和 2年 7月23日
期首元本額	15,415,163,759円
期中追加設定元本額	1,403,815,575円
期中一部解約元本額	2,898,552,702円

	[令和 3年 7月26日現在]
元本の内訳	
三菱ＵＦＪ 日本株アクティブオープン	2,830,309,516円
三菱ＵＦＪ 日本株アクティブオープン（確定拠出年金）	8,619,920,643円
三菱ＵＦＪ バランスインカムオープン（毎月決算型）	1,687,566,084円
三菱ＵＦＪ ＤＣ金利連動アロケーション型バランスファンド	626,687,242円
三菱ＵＦＪ 日本株アクティブファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	155,943,147円
合計	13,920,426,632円
2. 受益権の総数	13,920,426,632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 7月23日 至 令和 3年 7月26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、株式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 7月26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。

区分	[令和 3年 7月26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 7月26日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	408,351,075
合計	408,351,075

(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 7月26日現在]
1口当たり純資産額	2.9805円
(1万口当たり純資産額)	(29,805円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1)株式

（単位：円）

			評価額	
--	--	--	-----	--

	銘 柄	株式数	単価	金額	備考
1407	ウエストホールディングス	143,000	4,630.00	662,090,000	
1861	熊谷組	122,600	2,897.00	355,172,200	
1893	五洋建設	487,700	761.00	371,139,700	
2871	ニチレイ	90,300	3,015.00	272,254,500	
2897	日清食品ホールディングス	39,500	7,970.00	314,815,000	
4004	昭和電工	237,600	3,055.00	725,868,000	
4182	三菱瓦斯化学	340,000	2,307.00	784,380,000	
4186	東京応化工業	72,400	7,130.00	516,212,000	
4369	トリケミカル研究所	142,800	3,005.00	429,114,000	
4911	資生堂	84,500	7,630.00	644,735,000	
8113	ユニ・チャーム	43,500	4,450.00	193,575,000	
4516	日本新薬	43,000	8,690.00	373,670,000	
4552	ＪＣＲファーマ	73,000	3,315.00	241,995,000	
4565	ソーせいグループ	205,000	1,757.00	360,185,000	
4568	第一三共	412,700	2,256.50	931,257,550	
3110	日東紡績	30,800	3,355.00	103,334,000	
5301	東海カーボン	290,900	1,429.00	415,696,100	
5706	三井金属鉱業	114,100	3,045.00	347,434,500	
5713	住友金属鉱山	67,200	4,280.00	287,616,000	
6101	ツガミ	128,800	1,678.00	216,126,400	
6145	N I T T O K U	46,800	3,925.00	183,690,000	
6273	S M C	8,900	65,790.00	585,531,000	
6383	ダイフク	15,300	9,980.00	152,694,000	
6407	C K D	227,800	2,210.00	503,438,000	
6481	T H K	106,000	3,265.00	346,090,000	
4062	イビデン	169,000	5,790.00	978,510,000	
6504	富士電機	94,000	5,140.00	483,160,000	
6506	安川電機	75,600	5,320.00	402,192,000	
6594	日本電産	53,600	12,580.00	674,288,000	
6758	ソニーグループ	114,700	10,975.00	1,258,832,500	
6762	T D K	26,300	13,180.00	346,634,000	
6857	アドバンテスト	82,100	9,270.00	761,067,000	
6861	キーエンス	7,100	57,530.00	408,463,000	
6920	レーザーテック	21,000	21,720.00	456,120,000	
6952	カシオ計算機	108,900	1,792.00	195,148,800	
6967	新光電気工業	110,000	3,835.00	421,850,000	
6976	太陽誘電	43,500	5,380.00	234,030,000	
7276	小糸製作所	83,400	6,790.00	566,286,000	
7735	S C R E E Nホールディングス	57,000	9,550.00	544,350,000	
8035	東京エレクトロン	22,000	45,370.00	998,140,000	
6201	豊田自動織機	62,100	9,300.00	577,530,000	

6902	デンソー	81,900	7,330.00	600,327,000	
7012	川崎重工業	162,900	2,280.00	371,412,000	
7203	トヨタ自動車	160,000	9,829.00	1,572,640,000	
7267	本田技研工業	59,300	3,440.00	203,992,000	
7269	スズキ	82,000	4,479.00	367,278,000	
7282	豊田合成	201,500	2,649.00	533,773,500	
7733	オリンパス	284,000	2,240.00	636,160,000	
7741	H O Y A	15,000	15,120.00	226,800,000	
7747	朝日インテック	192,000	2,953.00	566,976,000	
7951	ヤマハ	58,300	6,130.00	357,379,000	
7974	任天堂	8,100	60,120.00	486,972,000	
9020	東日本旅客鉄道	27,300	7,515.00	205,159,500	
9022	東海旅客鉄道	13,300	16,155.00	214,861,500	
9076	セイノーホールディングス	197,100	1,416.00	279,093,600	
9143	S Gホールディングス	66,400	3,025.00	200,860,000	
9104	商船三井	62,000	5,000.00	310,000,000	
3769	G M Oペイメントゲートウェイ	30,200	14,420.00	435,484,000	
3774	インターネットイニシアティブ	139,700	3,585.00	500,824,500	
3994	マネーフォワード	62,500	6,870.00	429,375,000	
4385	メルカリ	40,300	5,670.00	228,501,000	
4443	S a n s a n	47,500	8,970.00	426,075,000	
4689	Zホールディングス	507,500	581.10	294,908,250	
7518	ネットワンシステムズ	82,500	3,785.00	312,262,500	
8056	日本ユニシス	128,800	3,420.00	440,496,000	
9433	K D D I	176,100	3,469.00	610,890,900	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	75,600	5,750.00	434,700,000	
9984	ソフトバンクグループ	128,500	7,106.00	913,121,000	
8001	伊藤忠商事	99,200	3,273.00	324,681,600	
8031	三井物産	408,000	2,554.00	1,042,032,000	
3092	Z O Z O	54,800	3,470.00	190,156,000	
3563	F O O D & L I F E C O M P A N I E	103,000	4,290.00	441,870,000	
7532	パン・パシフィック・インターナショナルホ	162,000	2,396.00	388,152,000	
8252	丸井グループ	140,300	1,974.00	276,952,200	
9983	ファーストリテイリング	5,600	75,810.00	424,536,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,162,500	580.00	1,254,250,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	203,500	3,693.00	751,525,500	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	165,600	1,846.00	305,697,600	
8473	S B Iホールディングス	117,700	2,596.00	305,549,200	
8750	第一生命ホールディングス	335,900	1,973.50	662,898,650	
8766	東京海上ホールディングス	99,700	5,252.00	523,624,400	

8801	三井不動産	228,000	2,573.00	586,644,000	
2413	エムスリー	22,300	7,560.00	168,588,000	
2427	アウトソーシング	143,000	2,114.00	302,302,000	
4751	サイバーエージェント	95,000	2,228.00	211,660,000	
6532	ペイカレント・コンサルティング	20,900	42,400.00	886,160,000	
7065	ユーピーアール	11,500	2,423.00	27,864,500	
合 計		12,373,300		40,860,180,150	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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。

日本債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 3年 7月26日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	375,743,944
国債証券	5,297,051,300
社債券	3,228,718,000
未収利息	18,870,363
前払費用	356,222
流動資産合計	8,920,739,829
資産合計	8,920,739,829
負債の部	
流動負債	
未払解約金	57,645,465
未払利息	372
流動負債合計	57,645,837
負債合計	57,645,837
純資産の部	
元本等	
元本	5,915,289,845
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,947,804,147
元本等合計	8,863,093,992
純資産合計	8,863,093,992
負債純資産合計	8,920,739,829

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。
--------------------	---

（重要な会計上の見積りに関する注記）

[令和 3年 7月26日現在]

当期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当期間の翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 3年 7月26日現在]
1. 期首	令和 2年 7月23日
期首元本額	5,556,323,943円
期中追加設定元本額	906,701,657円
期中一部解約元本額	547,735,755円
元本の内訳	
三菱ＵＦＪ ＤＣ金利連動アロケーション型バランスファンド	2,531,817,646円
三菱ＵＦＪ 日本債券ファンドＦ（適格機関投資家限定）	57,102,838円
三菱ＵＦＪ グローバルバランス（積極型）	171,843,668円
三菱ＵＦＪ グローバルバランス（安定型）	252,352,138円
三菱ＵＦＪ グローバルバランスＶＡ	18,158,370円
三菱ＵＦＪ 国内バランス２０	1,075,081,344円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞日本債券ファンド	1,347,165,612円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞グローバルバランス ２０型	164,063,306円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞グローバルバランス ４０型	178,820,467円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞グローバルバランス ６０型	118,884,456円
合計	5,915,289,845円
2. 受益権の総数	5,915,289,845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 7月23日 至 令和 3年 7月26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 7月26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 7月26日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	16,505,500
社債券	9,562,000
合計	6,943,500

(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 7月26日現在]
1口当たり純資産額	1.4983円
(1万口当たり純資産額)	(14,983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 4 2 6 回利付国債（ 2 年 ）	80,000,000	80,216,000	
	第 5 回利付国債（ 4 0 年 ）	70,000,000	95,989,600	
	第 7 回利付国債（ 4 0 年 ）	50,000,000	64,925,500	
	第 1 0 回利付国債（ 4 0 年 ）	40,000,000	42,585,600	
	第 1 1 回利付国債（ 4 0 年 ）	40,000,000	41,286,800	
	第 1 4 回利付国債（ 4 0 年 ）	10,000,000	9,907,700	
	第 3 5 0 回利付国債（ 1 0 年 ）	40,000,000	40,616,800	
	第 3 5 1 回利付国債（ 1 0 年 ）	40,000,000	40,640,400	
	第 3 5 2 回利付国債（ 1 0 年 ）	80,000,000	81,328,000	
	第 3 5 4 回利付国債（ 1 0 年 ）	120,000,000	121,989,600	
	第 3 5 6 回利付国債（ 1 0 年 ）	70,000,000	71,092,000	
	第 3 5 7 回利付国債（ 1 0 年 ）	10,000,000	10,152,200	

第３６０回利付国債（１０年）	210,000,000	212,601,900	
第３６１回利付国債（１０年）	10,000,000	10,113,000	
第３６３回利付国債（１０年）	40,000,000	40,355,600	
第２３回利付国債（３０年）	50,000,000	66,831,000	
第２６回利付国債（３０年）	30,000,000	39,982,800	
第２７回利付国債（３０年）	10,000,000	13,556,000	
第２８回利付国債（３０年）	30,000,000	40,885,500	
第２９回利付国債（３０年）	20,000,000	27,049,200	
第３０回利付国債（３０年）	50,000,000	67,040,000	
第３１回利付国債（３０年）	20,000,000	26,563,800	
第３２回利付国債（３０年）	40,000,000	54,079,200	
第３３回利付国債（３０年）	40,000,000	52,032,000	
第３４回利付国債（３０年）	50,000,000	67,127,000	
第３６回利付国債（３０年）	60,000,000	78,834,600	
第３７回利付国債（３０年）	40,000,000	51,902,800	
第３８回利付国債（３０年）	10,000,000	12,801,700	
第３９回利付国債（３０年）	50,000,000	65,166,500	
第４２回利付国債（３０年）	30,000,000	37,980,000	
第４４回利付国債（３０年）	30,000,000	38,061,900	
第４６回利付国債（３０年）	50,000,000	61,351,500	
第４７回利付国債（３０年）	20,000,000	25,016,800	
第４９回利付国債（３０年）	30,000,000	36,186,300	
第５０回利付国債（３０年）	50,000,000	53,349,500	
第５３回利付国債（３０年）	20,000,000	20,336,000	
第５４回利付国債（３０年）	80,000,000	85,068,800	
第５８回利付国債（３０年）	110,000,000	116,391,000	
第６０回利付国債（３０年）	100,000,000	108,140,000	
第６１回利付国債（３０年）	40,000,000	41,183,200	
第６７回利付国債（３０年）	150,000,000	149,082,000	
第１０５回利付国債（２０年）	50,000,000	58,026,500	
第１１０回利付国債（２０年）	40,000,000	46,834,800	
第１１１回利付国債（２０年）	40,000,000	47,343,200	
第１１３回利付国債（２０年）	50,000,000	58,990,500	
第１１４回利付国債（２０年）	70,000,000	82,904,500	
第１１６回利付国債（２０年）	50,000,000	59,847,500	
第１１８回利付国債（２０年）	50,000,000	59,161,500	
第１２１回利付国債（２０年）	30,000,000	35,328,900	
第１２３回利付国債（２０年）	80,000,000	95,972,000	
第１２５回利付国債（２０年）	70,000,000	84,896,000	
第１２８回利付国債（２０年）	110,000,000	130,557,900	
第１３０回利付国債（２０年）	80,000,000	94,424,800	
第１３２回利付国債（２０年）	60,000,000	70,387,800	

	第１３６回利付国債（２０年）	90,000,000	104,884,200	
	第１３７回利付国債（２０年）	50,000,000	58,942,500	
	第１４０回利付国債（２０年）	50,000,000	59,082,500	
	第１４１回利付国債（２０年）	40,000,000	47,400,400	
	第１４３回利付国債（２０年）	100,000,000	117,607,000	
	第１４５回利付国債（２０年）	50,000,000	59,511,500	
	第１４６回利付国債（２０年）	110,000,000	131,285,000	
	第１４７回利付国債（２０年）	40,000,000	47,348,800	
	第１４８回利付国債（２０年）	30,000,000	35,201,100	
	第１４９回利付国債（２０年）	100,000,000	117,528,000	
	第１５０回利付国債（２０年）	80,000,000	93,136,000	
	第１５２回利付国債（２０年）	90,000,000	102,636,900	
	第１５３回利付国債（２０年）	90,000,000	103,949,100	
	第１５４回利付国債（２０年）	90,000,000	102,808,800	
	第１５５回利付国債（２０年）	90,000,000	100,358,100	
	第１５７回利付国債（２０年）	50,000,000	49,963,500	
	第１５８回利付国債（２０年）	60,000,000	62,554,800	
	第１５９回利付国債（２０年）	80,000,000	84,528,000	
	第１６０回利付国債（２０年）	70,000,000	75,025,300	
	第１６２回利付国債（２０年）	100,000,000	105,515,000	
	第１６４回利付国債（２０年）	70,000,000	72,622,200	
	第１６６回利付国債（２０年）	130,000,000	138,934,900	
	第１６７回利付国債（２０年）	40,000,000	41,356,800	
	第１６９回利付国債（２０年）	10,000,000	9,957,700	
	第１７２回利付国債（２０年）	50,000,000	50,437,500	
国債証券 合計		4,660,000,000	5,297,051,300	
社債券	第２３回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	99,991,000	
	第６回マラヤン・バンキング	200,000,000	199,682,000	
	第１回パークレイズ・ピーエルシー期限前償還条項付	100,000,000	101,695,000	
	第３回ソシエテ ジェネラル円貨社債（２０１８）	100,000,000	100,721,000	
	NATWEST MARKETS	100,000,000	100,378,000	
	UBS GROUP FUNDING（SWITZERLAND）	100,000,000	100,259,000	
	第１４回セブン＆アイ・ホールディングス	100,000,000	100,399,000	
	第１６回Ｚホールディングス	100,000,000	100,983,000	
	第３４回ソニー	100,000,000	100,143,000	
	第４３回ＩＨＩ	100,000,000	99,686,000	
	第１５回ＪＡ三井リース	100,000,000	100,233,000	
	第１回明治安田生命２０１７基金	100,000,000	100,111,000	
	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	100,194,000	
	第１回日本生命２０１９基金	100,000,000	99,990,000	

第１回明治安田生命２０１９基金	100,000,000	100,020,000	
第１回楽天カード	100,000,000	99,902,000	
第１３回住友信託銀行（劣後特約付）	100,000,000	109,543,000	
第１４回住友信託銀行劣後特約付	100,000,000	109,168,000	
第１回みずほフィナンシャルグループ	100,000,000	101,338,000	
第２０回みずほ銀行（劣後特約付）	200,000,000	202,114,000	
第１６回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	100,000,000	100,399,000	
第９１回トヨタファイナンス	100,000,000	100,299,000	
第１６回イオンフィナンシャルサービス	200,000,000	200,052,000	
第７５回アコム	100,000,000	100,171,000	
第７９回アコム	100,000,000	100,095,000	
第１回野村ホールディングス	100,000,000	100,123,000	
第２回ソフトバンク	100,000,000	100,314,000	
第８回ソフトバンク	100,000,000	100,393,000	
第４８２回九州電力	100,000,000	100,322,000	
社債券 合計	3,200,000,000	3,228,718,000	
合計	7,860,000,000	8,525,769,300	

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。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 3年 7月26日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	198,488,217
コール・ローン	96,617,877
株式	12,890,450,288
投資証券	281,523,413
派生商品評価勘定	13,338
未収配当金	13,974,295
流動資産合計	13,481,067,428
資産合計	13,481,067,428
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	392,235
未払金	53,020,811

[令和 3年 7月26日現在]

未払解約金	26,652,616
未払利息	95
流動負債合計	80,065,757
負債合計	80,065,757
純資産の部	
元本等	
元本	4,074,750,879
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	9,326,250,792
元本等合計	13,401,001,671
純資産合計	13,401,001,671
負債純資産合計	13,481,067,428

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	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 投資証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値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。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

[令和 3年 7月26日現在]

当期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当期間の翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 3年 7月26日現在]
1. 期首	令和 2年 7月23日
期首元本額	4,223,651,806円
期中追加設定元本額	255,792,812円
期中一部解約元本額	404,693,739円
元本の内訳	
三菱ＵＦＪ ＤＣ金利連動アロケーション型バランスファンド	583,605,967円
三菱ＵＦＪ グローバルバランス（積極型）	60,045,556円
三菱ＵＦＪ グローバルバランス（安定型）	37,210,262円
三菱ＵＦＪ グローバルバランスＶＡ	2,654,308円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>海外株式オープン	3,314,250,442円

	[令和 3年 7月26日現在]
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>グローバルバランス ２０型	9,539,174円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>グローバルバランス ４０型	26,135,949円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>グローバルバランス ６０型	41,309,221円
合計	4,074,750,879円
２．受益権の総数	4,074,750,879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 7月23日 至 令和 3年 7月26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、株式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、投資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、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、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 7月26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

区分	[令和 3年 7月26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	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。 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 7月26日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	1,650,322,569
投資証券	56,657,993
合計	1,706,980,562

(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 7月26日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	2,557,952	—	2,571,290	13,338
	売建				
	アメリカドル	43,837,652	—	44,215,480	377,828
	香港ドル	2,557,952	—	2,572,359	14,407
合計		48,953,556	—	49,359,129	378,897

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[令和 3年 7月26日現在]
1口当たり純資産額	3.2888円
(1万口当たり純資産額)	(32,888円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	23,868	20.21	482,372.28	
	LOCKHEED MARTIN CORP	4,392	380.77	1,672,341.84	
	OTIS WORLDWIDE CORP	24,383	88.52	2,158,383.16	
	RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	20,912	85.81	1,794,458.72	
	HASBRO INC	25,468	92.41	2,353,497.88	
	COMCAST CORP-CLASS A	39,080	58.36	2,280,708.80	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	18,211	98.40	1,791,962.40	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	5,702	333.55	1,901,902.10	
	MEDTRONIC PLC	9,662	128.54	1,241,953.48	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	9,017	417.70	3,766,400.90	
	ABBVIE INC	27,940	118.19	3,302,228.60	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	50,327	68.34	3,439,347.18	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP	61,133	43.63	2,667,232.79	
	M & T BANK CORP	15,752	129.33	2,037,206.16	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	31,733	121.36	3,851,116.88	
	SYNCHRONY FINANCIAL	39,068	46.51	1,817,052.68	

	ASSURANT INC	15,354	155.02	2,380,177.08	
	PROGRESSIVE CORP	18,383	94.73	1,741,421.59	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	24,631	148.83	3,665,831.73	
	INTUIT INC	5,002	528.43	2,643,206.86	
	MICROSOFT CORP	17,119	289.67	4,958,860.73	
	PAYCHEX INC	9,434	112.25	1,058,966.50	
	VISA INC-CLASS A SHARES	13,742	249.02	3,422,032.84	
	TE CONNECTIVITY LTD	11,258	138.35	1,557,544.30	
	TELUS CORP	157,022	22.01	3,456,054.22	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	17,339	186.85	3,239,792.15	
アメリカドル 小計		695,932		64,682,053.85 (7,149,954,232)	
オーストラリアドル	ANSELL LTD	30,299	41.13	1,246,197.87	
オーストラリアドル 小計		30,299		1,246,197.87 (101,266,038)	
イギリスポンド	BAE SYSTEMS PLC	165,048	5.52	911,064.96	
	FERGUSON PLC	22,411	103.95	2,329,623.45	
	DIAGEO PLC	64,242	35.05	2,252,003.31	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	50,488	62.64	3,162,568.32	
	ASTRAZENECA PLC	25,796	84.80	2,187,500.80	
	PRUDENTIAL PLC	158,587	13.64	2,163,919.61	
イギリスポンド 小計		486,572		13,006,680.45 (1,976,104,960)	
香港ドル	CHINA FEIHE LTD	801,000	16.58	13,280,580.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	57,900	164.80	9,541,920.00	
香港ドル 小計		858,900		22,822,500.00 (324,764,175)	
シンガポールドル	DBS GROUP HOLDINGS LTD	52,700	30.21	1,592,067.00	
シンガポールドル 小計		52,700		1,592,067.00 (129,243,999)	
デンマーククローネ	NOVO NORDISK A/S-B	27,252	570.90	15,558,166.80	
デンマーククローネ 小計		27,252		15,558,166.80 (272,112,337)	
メキシコペソ	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	376,538	64.86	24,422,254.68	
メキシコペソ 小計		376,538		24,422,254.68 (134,490,914)	
ニュー台湾ドル	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	183,000	585.00	107,055,000.00	
ニュー台湾ドル 小計		183,000		107,055,000.00 (421,796,700)	
ユーロ	SCHNEIDER ELECTRIC SE	12,062	140.18	1,690,851.16	
	RELX PLC	160,883	24.31	3,911,065.73	

	ESSILORLUXOTTICA	9,849	155.12	1,527,776.88	
	KERING	2,094	747.60	1,565,474.40	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	2,774	674.00	1,869,676.00	
	UNILEVER PLC	51,490	48.47	2,495,720.30	
	SANOFI	42,641	88.07	3,755,392.87	
	AMADEUS IT GROUP SA	26,419	56.46	1,491,616.74	
ユーロ 小計		308,212		18,307,574.08 (2,380,716,933)	
合 計		3,019,405		12,890,450,288 (12,890,450,288)	

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の()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。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
アメリカドル	投資証券	AMERICAN TOWER CORP	8,928	2,546,801.28	
アメリカドル合計			8,928	2,546,801.28 (281,523,413)	
合 計				281,523,413 (281,523,413)	

(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	組入株式 時価比率	組入投資証券 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	株式 26銘柄	96.21%	—	54.28%
	投資証券 1銘柄	—	3.79%	2.14%
オーストラリアドル	株式 1銘柄	100.00%	—	0.77%
イギリスポンド	株式 6銘柄	100.00%	—	15.00%
香港ドル	株式 2銘柄	100.00%	—	2.47%
シンガポールドル	株式 1銘柄	100.00%	—	0.98%
デンマーククローネ	株式 1銘柄	100.00%	—	2.07%
メキシコペソ	株式 1銘柄	100.00%	—	1.02%
ニュー台湾ドル	株式 1銘柄	100.00%	—	3.20%
ユーロ	株式 8銘柄	100.00%	—	18.07%

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 海外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 7月26日現在]	
資産の部	
流動資産	
預金	2,010,961,329
コール・ローン	190,872,123
国債証券	43,652,099,722
特殊債券	1,893,866,036
社債券	589,150,986
未収入金	1,341,439,042
未収利息	280,437,833
前払費用	32,035,651
流動資産合計	49,990,862,722
資産合計	49,990,862,722
負債の部	
流動負債	
未払金	1,667,983,486
未払解約金	28,492,835
未払利息	189
流動負債合計	1,696,476,510
負債合計	1,696,476,510
純資産の部	
元本等	
元本	14,441,336,174
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	33,853,050,038
元本等合計	48,294,386,212
純資産合計	48,294,386,212
負債純資産合計	49,990,862,722

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。
---------------------------	--

（重要な会計上の見積りに関する注記）

[令和3年7月26日現在]

当期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当期間の翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[令和3年7月26日現在]
1. 期首	令和2年7月23日
期首元本額	14,419,693,520円
期中追加設定元本額	1,424,840,094円
期中一部解約元本額	1,403,197,440円
元本の内訳	
三菱ＵＦＪ バランスインカムオープン（毎月決算型）	3,489,341,083円
三菱ＵＦＪ ＤＣ金利連動アロケーション型バランスファンド	569,311,778円
三菱ＵＦＪ ライフプラン 25	25,433,099円
三菱ＵＦＪ ライフプラン 50	55,321,429円
三菱ＵＦＪ ライフプラン 75	14,076,568円
三菱ＵＦＪ 海外債券オープン	4,381,770,716円
三菱ＵＦＪ 海外債券オープン（3ヵ月決算型）	3,632,419,324円
三菱ＵＦＪ ライフプラン 50VA（適格機関投資家限定）	21,631,344円
三菱ＵＦＪ 海外債券オープンVA（適格機関投資家限定）	60,734,705円
三菱ＵＦＪ 世界バランスファンド 25VA（適格機関投資家限定）	44,830,126円
三菱ＵＦＪ 世界バランスファンド 50VA（適格機関投資家限定）	159,770,834円
三菱ＵＦＪ国際 海外債券オープン（適格機関投資家限定）	1,840,497,579円
三菱ＵＦＪ グローバルバランス（積極型）	21,408,401円
三菱ＵＦＪ グローバルバランス（安定型）	15,954,788円
三菱ＵＦＪ グローバルバランスVA	1,141,793円
三菱ＵＦＪ ライフ・バランスファンド（安定型）	7,473,317円
三菱ＵＦＪ ライフ・バランスファンド（安定成長型）	4,848,815円
三菱ＵＦＪ ライフ・バランスファンド（成長型）	3,042,273円
三菱ＵＦＪ ライフ・バランスファンド（積極型）	2,772,569円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤーファンド 2030	1,083,874円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤーファンド 2040	966,968円
三菱ＵＦＪ <DC>ライフ・バランスファンド（安定型）	6,651,488円
三菱ＵＦＪ <DC>ライフ・バランスファンド（安定成長型）	13,575,072円
三菱ＵＦＪ <DC>ライフ・バランスファンド（成長型）	8,462,429円

	[令和 3年 7月26日現在]
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>ライフ・バランスファンド（積極型）	4,069,419円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>ターゲット・イヤー ファンド 2030	11,651,479円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>ターゲット・イヤー ファンド 2040	10,800,024円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>グローバルバランス 20型	6,256,608円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>グローバルバランス 40型	11,271,202円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>グローバルバランス 60型	14,767,070円
合計	14,441,336,174円
2. 受益権の総数	14,441,336,174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 7月23日 至 令和 3年 7月26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、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。
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 7月26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

区分	[令和 3年 7月26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 7月26日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	645,460,251
特殊債券	55,432,027
社債券	14,777,926
合計	715,670,204

(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 7月26日現在]
1口当たり純資産額	3.3442円
(1万口当たり純資産額)	(33,442円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨	種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
アメリカドル	国債証券	1.125 T-NOTE 310215	15,000,000.00	14,795,507.79	
		1.25 T-BOND 500515	500,000.00	422,636.71	
		1.375 T-BOND 500815	1,000,000.00	872,031.25	
		1.625 T-NOTE 260215	19,000,000.00	19,815,664.05	
		1.75 T-NOTE 230515	31,000,000.00	31,870,664.04	
		1.875 T-BOND 510215	16,500,000.00	16,266,679.67	
		2 T-BOND 500215	500,000.00	506,914.06	
		2 T-NOTE 221031	35,000,000.00	35,835,351.54	
		2 T-NOTE 250815	19,000,000.00	20,080,625.00	
		2.25 T-NOTE 271115	12,000,000.00	12,967,968.74	
		2.75 T-NOTE 240215	13,500,000.00	14,347,441.39	
		2.875 T-BOND 490515	200,000.00	241,085.93	
		3.125 T-BOND 430215	7,500,000.00	9,183,691.39	
		3.125 T-BOND 440815	3,000,000.00	3,694,453.12	
		3.875 T-BOND 400815	4,000,000.00	5,378,750.00	
		4.5 T-BOND 360215	500,000.00	699,218.75	
		4.75 T-BOND 410215	5,000,000.00	7,491,796.87	
		国債証券 小計		183,200,000.00	194,470,480.30 (21,496,766,892)
	特殊債券	0.875 IBRD 300514	10,000,000.00	9,669,684.70	
	特殊債券 小計		10,000,000.00	9,669,684.70 (1,068,886,946)	
	社債券	3.875 COOPERATIEV 220208	4,000,000.00	4,078,494.24	
		7 IBM CORP 251030	1,000,000.00	1,251,259.57	
	社債券 小計		5,000,000.00	5,329,753.81 (589,150,986)	
アメリカドル合計			198,200,000.00	209,469,918.81 (23,154,804,824)	
カナダドル	国債証券	0.25 CAN GOVT 230201	4,000,000.00	3,995,340.00	
		1.5 CAN GOVT 260601	400,000.00	413,216.00	
		2 CAN GOVT 280601	700,000.00	747,171.60	
		2 CAN GOVT 511201	1,500,000.00	1,577,379.00	
		2.25 CAN GOVT 290601	9,000,000.00	9,814,968.00	
カナダドル合計			15,600,000.00	16,548,074.60 (1,454,079,315)	
	国債証券	1.75 AUST GOVT 510621	1,200,000.00	1,115,617.00	

オーストラリアドル	国債証券 小計		1,200,000.00	1,115,617.00 (90,655,037)	
	特殊債券	1.7 EIB 241115	1,000,000.00	1,039,009.00	
		3.2 INTL FINAN 271018	3,500,000.00	3,949,168.65	
	特殊債券 小計		4,500,000.00	4,988,177.65 (405,339,315)	
オーストラリアドル合計			5,700,000.00	6,103,794.65 (495,994,352)	
イギリスポンド	国債証券	0.125 GILT 230131	500,000.00	500,411.20	
		1.25 GILT 411022	4,000,000.00	4,184,396.80	
		1.75 GILT 490122	1,500,000.00	1,766,822.40	
		4.25 GILT 551207	1,900,000.00	3,723,018.46	
		4.75 GILT 301207	5,500,000.00	7,583,164.60	
	国債証券 小計		13,400,000.00	17,757,813.46 (2,697,944,598)	
	特殊債券	6 EIB 281207	2,000,000.00	2,762,060.00	
	特殊債券 小計		2,000,000.00	2,762,060.00 (419,639,775)	
イギリスポンド合計			15,400,000.00	20,519,873.46 (3,117,584,373)	
シンガポールドル	国債証券	2.375 SINGAPORGOV 250601	1,700,000.00	1,814,240.00	
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	600,000.00	711,900.00	
シンガポールドル合計			2,300,000.00	2,526,140.00 (205,072,045)	
マレーシアリングット	国債証券	3.882 MALAYSIAGOV 220310	1,500,000.00	1,519,746.30	
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	4,000,000.00	4,213,436.80	
		3.9 MALAYSIAGOVT 261130	3,000,000.00	3,190,259.40	
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	2,600,000.00	2,842,185.32	
マレーシアリングット合計			11,100,000.00	11,765,627.82 (307,598,220)	
スウェーデンクローネ	国債証券	0.125 SWD GOVT 310512	3,000,000.00	2,994,145.86	
		0.75 SWD GOVT 280512	5,000,000.00	5,271,650.00	
		1 SWD GOVT 261112	6,000,000.00	6,372,990.00	
スウェーデンクローネ合計			14,000,000.00	14,638,785.86 (185,912,580)	
ノルウェークローネ	国債証券	1.375 NORWE GOVT 300819	2,000,000.00	2,035,770.00	
		1.5 NORWE GOVT 260219	8,000,000.00	8,204,371.20	
ノルウェークローネ合計			10,000,000.00	10,240,141.20 (127,592,159)	
メキシコペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	15,000,000.00	16,663,284.00	
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	10,000,000.00	10,086,189.00	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	20,000,000.00	20,729,926.00	

		7.75 MEXICAN BONO 310529	10,000,000.00	10,542,900.00	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	20,000,000.00	21,899,620.00	
メキシコペソ合計			75,000,000.00	79,921,919.00 (440,122,015)	
イスラエル シェケル	国債証券	0.75 ISRAEL FIXED 220731	1,000,000.00	1,007,250.00	
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	4,000,000.00	3,998,800.00	
イスラエルシェケル合計			5,000,000.00	5,006,050.00 (169,226,516)	
ポーランド ズロチ	国債証券	2.5 POLAND 240425	7,200,000.00	7,598,520.00	
		2.75 POLAND 291025	3,500,000.00	3,871,700.00	
ポーランドズロチ合計			10,700,000.00	11,470,220.00 (325,673,956)	
ユーロ	国債証券	0 ITALY GOVT 260401	10,000,000.00	10,020,687.00	
		0 NETH GOVT 520115	300,000.00	287,216.70	
		0 O.A.T 301125	4,000,000.00	4,065,700.00	
		0.2 IRISH GOVT 301018	1,000,000.00	1,031,886.00	
		0.25 BUND 280815	3,700,000.00	3,933,935.09	
		0.25 ITALY GOVT 280315	1,500,000.00	1,502,842.20	
		0.25 NETH GOVT 290715	4,000,000.00	4,222,920.00	
		0.4 IRISH GOVT 350515	400,000.00	411,968.00	
		0.5 SPAIN GOVT 300430	4,500,000.00	4,666,293.00	
		0.75 O.A.T 520525	3,800,000.00	3,849,620.40	
		0.9 BEL GOVT 290622	4,800,000.00	5,276,385.60	
		0.95 ITALY GOVT 300801	1,000,000.00	1,038,804.00	
		1 SPAIN GOVT 501031	2,500,000.00	2,398,555.00	
		1.1 IRISH GOVT 290515	1,500,000.00	1,663,104.00	
		1.25 BUND 480815	1,500,000.00	1,993,243.50	
		1.25 O.A.T 360525	7,000,000.00	8,071,686.00	
		1.6 BEL GOVT 470622	700,000.00	867,501.60	
		1.7 BEL GOVT 500622	400,000.00	508,692.64	
		1.75 ITALY GOVT 240701	13,000,000.00	13,771,550.00	
		1.85 ITALY GOVT 240515	3,000,000.00	3,181,352.10	
		1.95 SPAIN GOVT 260430	11,000,000.00	12,232,660.00	
		2.35 SPAIN GOVT 330730	9,000,000.00	11,069,622.00	
		2.45 ITALY GOVT 330901	2,000,000.00	2,372,982.80	
		2.45 ITALY GOVT 500901	5,500,000.00	6,582,510.00	
		4.75 BUND 400704	2,200,000.00	4,298,628.40	
		4.75 ITALY GOVT 280901	3,300,000.00	4,337,998.50	
		4.9 SPAIN GOVT 400730	400,000.00	693,768.16	
		5 ITALY GOVT 400901	2,000,000.00	3,265,272.00	
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5,000,000.00	6,586,371.00	
			109,000,000.00	124,203,755.69	

ユーロ合計		(16,151,456,389)	
合計		46,135,116,744 (46,135,116,744)	

(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 17銘柄	92.84%	46.60%
	特殊債券 1銘柄	4.62%	2.32%
	社債券 2銘柄	2.54%	1.28%
カナダドル	国債証券 5銘柄	100.00%	3.15%
オーストラリアドル	国債証券 1銘柄	18.28%	0.20%
	特殊債券 2銘柄	81.72%	0.88%
イギリスポンド	国債証券 5銘柄	86.54%	5.85%
	特殊債券 1銘柄	13.46%	0.91%
シンガポールドル	国債証券 2銘柄	100.00%	0.44%
マレーシアリンギット	国債証券 4銘柄	100.00%	0.67%
スウェーデンクローネ	国債証券 3銘柄	100.00%	0.40%
ノルウェークローネ	国債証券 2銘柄	100.00%	0.28%
メキシコペソ	国債証券 5銘柄	100.00%	0.95%
イスラエルシェケル	国債証券 2銘柄	100.00%	0.37%
ポーランドズロチ	国債証券 2銘柄	100.00%	0.71%
ユーロ	国債証券 29銘柄	100.00%	35.01%

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。

マネー・マーケット・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 3年 7月26日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	207,599,425
現先取引勘定	1,099,999,966
流動資産合計	1,307,599,391
資産合計	1,307,599,391
負債の部	
流動負債	
未払解約金	52,486
未払利息	205
流動負債合計	52,691
負債合計	52,691
純資産の部	
元本等	
元本	1,284,185,290
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	23,361,410
元本等合計	1,307,546,700
純資産合計	1,307,546,700
負債純資産合計	1,307,599,391

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

[令和 3年 7月26日現在]

当期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当期間の翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 3年 7月26日現在]
1. 期首	令和 2年 7月23日
期首元本額	1,246,864,534円
期中追加設定元本額	371,802,527円
期中一部解約元本額	334,481,771円
元本の内訳	
三菱ＵＦＪ ＤＣ金利連動アロケーション型バランスファンド	468,682,713円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース> （毎月分配型）	3,683,862円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース> （毎月分配型）	2,590,474円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース> （毎月分配型）	111,354円

	[令和 3年 7月26日現在]
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>（毎月分配型）	9,893,887円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>（毎月分配型）	24,765,135円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース>（毎月分配型）	282,290円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>（毎月分配型）	1,860,635円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	53,075,700円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<中国元コース>（毎月分配型）	89,620円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<インドネシアルピアコース>（毎月分配型）	1,033,322円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>（毎月分配型）	212,322円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド（毎月分配型）	10,715,809円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド（毎月分配型）	1,378,553円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース>（毎月分配型）	5,548,198円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルリアルコース>（毎月分配型）	123,415円
三菱ＵＦＪ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>（毎月分配型）	3,857,128円
三菱ＵＦＪ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>（毎月分配型）	2,016,707円
三菱ＵＦＪ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>（毎月分配型）	1,145,161円
三菱ＵＦＪ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>（毎月分配型）	16,341,949円
三菱ＵＦＪ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>（毎月分配型）	1,513,806円
三菱ＵＦＪ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<アジアバスケット通貨コース>（毎月分配型）	642,729円
三菱ＵＦＪ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	93,838,406円
三菱ＵＦＪ 欧州ハイイールド債券ファンド ユーロ円プレミアム（毎月分配型）	11,916,657円
欧州ハイイールド債券ファンド（為替ヘッジあり）	6,336,371円
欧州ハイイールド債券ファンド（為替ヘッジなし）	6,643,326円
三菱ＵＦＪ 米国リートファンドA<為替ヘッジあり>（毎月決算型）	491,836円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース>（毎月分配型）	4,489,124円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド（年2回分配型）	30,649円

	[令和 3年 7月26日現在]
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド（年2回分配型）	60,179円
PIMCO ニューワールドインカムファンド＜豪ドルコース＞（年2回分配型）	69,757円
PIMCO ニューワールドインカムファンド＜ブラジルリアルコース＞（年2回分配型）	10,814円
PIMCO ニューワールドインカムファンド＜メキシコペソコース＞（年2回分配型）	278,281円
三菱ＵＦＪ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ＜メキシコペソコース＞（毎月分配型）	665,580円
三菱ＵＦＪ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ＜トルコリラコース＞（毎月分配型）	2,308,140円
三菱ＵＦＪ 米国高配当株式プラス＜為替ヘッジあり＞（毎月決算型）	491,449円
三菱ＵＦＪ 米国高配当株式プラス＜為替ヘッジなし＞（毎月決算型）	9,828,976円
PIMCO ニューワールドインカムファンド＜世界通貨分散コース＞（毎月分配型）	3,307,993円
PIMCO ニューワールドインカムファンド＜世界通貨分散コース＞（年2回分配型）	132,542円
バリュー・ボンド・ファンド＜為替リスク軽減型＞（毎月決算型）	1,936,118円
バリュー・ボンド・ファンド＜為替ヘッジなし＞（毎月決算型）	9,829円
バリュー・ボンド・ファンド＜為替リスク軽減型＞（年1回決算型）	9,829円
バリュー・ボンド・ファンド＜為替ヘッジなし＞（年1回決算型）	9,829円
三菱ＵＦＪ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ＜円コース＞（毎月分配型）	3,156,977円
三菱ＵＦＪ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ＜米ドルコース＞（毎月分配型）	7,196,270円
三菱ＵＦＪ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ＜豪ドルコース＞（毎月分配型）	1,491,640円
三菱ＵＦＪ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ＜ブラジルリアルコース＞（毎月分配型）	3,517,041円
三菱ＵＦＪ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ＜メキシコペソコース＞（毎月分配型）	845,131円
三菱ＵＦＪ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ＜トルコリラコース＞（毎月分配型）	2,156,093円
三菱ＵＦＪ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ＜ロシアルーブルコース＞（毎月分配型）	5,114,733円
三菱ＵＦＪ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ＜円コース＞（年2回分配型）	1,528,278円
三菱ＵＦＪ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ＜米ドルコース＞（年2回分配型）	2,664,317円
三菱ＵＦＪ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ＜豪ドルコース＞（年2回分配型）	215,434円

	[令和 3年 7月26日現在]
三菱ＵＦＪ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>（年2回分配型）	490,224円
三菱ＵＦＪ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース>（年2回分配型）	175,974円
三菱ＵＦＪ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>（年2回分配型）	409,936円
三菱ＵＦＪ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース>（年2回分配型）	345,928円
三菱ＵＦＪ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンドA>	48,798,875円
三菱ＵＦＪ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンドB>	1,355,269円
三菱ＵＦＪ / ピムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型>（毎月決算型）	3,308,438円
三菱ＵＦＪ / ピムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし>（毎月決算型）	5,411,821円
三菱ＵＦＪ / ピムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型>（年1回決算型）	1,609,969円
三菱ＵＦＪ / ピムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし>（年1回決算型）	2,065,331円
ピムコ・エマージング・ボンド・オープン Cコース（為替ヘッジなし）（年1回決算型）	521,457円
ピムコ・エマージング・ボンド・オープン Dコース（為替ヘッジあり）（年1回決算型）	354,513円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり>（毎月分配型）	2,542,269円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし>（毎月分配型）	5,812,610円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり>（毎月決算型）	3,545,187円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし>（毎月決算型）	8,124,755円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり>（年1回決算型）	2,990,177円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし>（年1回決算型）	3,377,211円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム>（毎月分配型）	8,478,079円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム>（年2回分配型）	4,145,749円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム>（毎月分配型）	8,067,104円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム>（年2回分配型）	3,319,056円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース>（毎月分配型）	20,075,917円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース>（年2回分配型）	1,616,484円
三菱ＵＦＪ / AMP オーストラリア・ハイインカム債券ファンド 豪ドル円プレミアム（毎月決算型）	5,899,118円
三菱ＵＦＪ 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム（毎月分配型）	4,433,586円

	[令和 3年 7月26日現在]
三菱ＵＦＪ 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム（年2回分配型）	1,171,788円
PIMCO 米国バンクローンファンド＜円インカム＞（毎月分配型）	20,609円
PIMCO 米国バンクローンファンド＜円インカム＞（年2回分配型）	10,795円
PIMCO 米国バンクローンファンド＜米ドルインカム＞（毎月分配型）	511,609円
PIMCO 米国バンクローンファンド＜米ドルインカム＞（年2回分配型）	177,761円
PIMCO 米国バンクローンファンド＜世界通貨分散コース＞（毎月分配型）	368,276円
PIMCO 米国バンクローンファンド＜世界通貨分散コース＞（年2回分配型）	89,371円
三菱ＵＦＪ リート不動産株ファンド＜米ドル投資型＞（3ヵ月決算型）	3,063,931円
三菱ＵＦＪ リート不動産株ファンド＜Wプレミアム＞（毎月決算型）	6,324,266円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	231,705,165円
マクロ・トータル・リターン・ファンド	9,820円
スマート・プロテクター90（限定追加型）2016-12	4,349,768円
スマート・プロテクター90オープン	981,933円
米国バンクローンファンド＜為替ヘッジあり＞（資産成長型）	138,394円
米国バンクローンファンド＜為替ヘッジなし＞（資産成長型）	138,420円
テンブルトン新興国小型株ファンド	49,097円
ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド＜限定為替ヘッジあり＞（毎月決算型）	2,259,287円
ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド＜限定為替ヘッジあり＞（年2回決算型）	10,781,250円
ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド＜為替ヘッジなし＞（毎月決算型）	2,474,981円
ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド＜為替ヘッジなし＞（年2回決算型）	9,376,245円
欧州ハイイールド債券ファンド（為替ヘッジあり）（年1回決算型）	82,770円
欧州ハイイールド債券ファンド（為替ヘッジなし）（年1回決算型）	87,384円
わたしの未来設計＜安定重視型＞（分配コース）	9,820円
わたしの未来設計＜安定重視型＞（分配抑制コース）	9,820円
わたしの未来設計＜成長重視型＞（分配コース）	9,820円
わたしの未来設計＜成長重視型＞（分配抑制コース）	9,820円
ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド	9,821円
グローバル・インカム・フルコース（為替リスク軽減型）	983円
グローバル・インカム・フルコース（為替ヘッジなし）	983円

	[令和 3年 7月26日現在]
< D C > ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド	9,821円
ベイリー・ギフォード インパクト投資ファンド	9,821円
< D C > ベイリー・ギフォード E S G 世界株ファンド	9,822円
ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド（予想分配金提示型）	9,822円
ベイリー・ギフォード インパクト投資ファンド（予想分配金提示型）	9,822円
米国株式トレンド・ウォッチ戦略ファンド	983円
三菱ＵＦＪ インド債券オープン（毎月決算型）	39,351円
三菱ＵＦＪ / A M P オーストラリア R E I T ファンド< W プレミアム>（毎月決算型）	11,293,333円
マネーブルファンド（ F O F s 用）（適格機関投資家限定）	9,879,892円
M U A M トピックスリスクコントロール（ 5 % ）インデックスファンド（ F O F s 用）（適格機関投資家限定）	5,827,524円
ピムコ・グローバル・ハイイールド・ファンド（毎月分配型）	11,784,347円
ピムコ・エマージング・ボンド・オープン A コース（為替ヘッジなし）	10,766,608円
ピムコ・エマージング・ボンド・オープン B コース（為替ヘッジあり）	9,187,206円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤーファンド 2 0 3 0	1,905,324円
三菱ＵＦＪ < D C > ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 0	21,636,222円
合計	1,284,185,290円
2. 受益権の総数	1,284,185,290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 7月23日 至 令和 3年 7月26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 7月26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、該当事項はありません。 (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）

該当事項はありません。

（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 7月26日現在]
1口当たり純資産額	1.0182円
(1万口当たり純資産額)	(10,182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

該当事項はありません。

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。

２【ファンドの現況】

【三菱ＵＦＪ ＤＣ金利連動アロケーション型バランスファンド】

【純資産額計算書】

令和 3年 7月30日現在

（単位：円）

資産総額	10,025,982,032
負債総額	17,412,432
純資産総額（ - ）	10,008,569,600
発行済口数	6,289,450,903口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.5913
（10,000口当たり）	（15,913）

（参考）

三菱ＵＦＪ 日本株アクティブマザーファンド

純資産額計算書

令和 3年 7月30日現在

（単位：円）

資産総額	41,240,140,029
負債総額	12,618,924
純資産総額（ - ）	41,227,521,105
発行済口数	13,960,321,787口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.9532
（10,000口当たり）	（29,532）

日本債券マザーファンド

純資産額計算書

令和 3年 7月30日現在

（単位：円）

資産総額	9,050,919,543
負債総額	107,422,083
純資産総額（ - ）	8,943,497,460
発行済口数	5,966,845,547口

1口当たり純資産価額（ / ）	1.4989
（ 10,000口当たり ）	（ 14,989 ）

外国株式マザーファンド

純資産額計算書

令和 3年 7月30日現在

（単位：円）

資産総額	13,532,990,246
負債総額	138,839,413
純資産総額（ - ）	13,394,150,833
発行済口数	4,097,629,651口
1口当たり純資産価額（ / ）	3.2688
（ 10,000口当たり ）	（ 32,688 ）

三菱ＵＦＪ 海外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 7月30日現在

（単位：円）

資産総額	49,080,715,779
負債総額	872,307,700
純資産総額（ - ）	48,208,408,079
発行済口数	14,465,667,019口
1口当たり純資産価額（ / ）	3.3326
（ 10,000口当たり ）	（ 33,326 ）

マネー・マーケット・マザーファンド

純資産額計算書

令和 3年 7月30日現在

（単位：円）

資産総額	1,314,598,283
負債総額	819,327
純資産総額（ - ）	1,313,778,956
発行済口数	1,290,306,987口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.0182

(10,000口当たり)

(10,182)

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換等

該当事項はありません。

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

（２）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

該当事項はありません。

（４）受益権の譲渡

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

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

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

（５）受益権の譲渡の対抗要件

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【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7月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近５年間における資本金の額の増減はありません。

（２）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

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

・投資運用の意思決定機構

投資環境見通しの策定

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

運用戦略の決定

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

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

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

投資行動のモニタリング１

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

投資行動のモニタリング２

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

ファンドに係る法人等の管理

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

運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

２【事業の内容及び営業の概況】

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

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

2021年 7月30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	888	17,602,272
追加型公社債投資信託	16	1,428,960
単位型株式投資信託	82	380,197
単位型公社債投資信託	45	190,275
合 計	1,031	19,601,705

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。

なお、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36期事業年度（自 令和2年4月1日 至 令和3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。

（１）【貸借対照表】

(単位：千円)

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金及び預金	2 56,398,457	2 56,803,388
有価証券	1,960,318	2,001
前払費用	575,904	598,135
未収入金	14,559	31,359
未収委託者報酬	10,296,453	13,216,357
未収収益	2 638,994	2 662,230
金銭の信託	100,000	2,300,000

その他		254,330		269,506
流動資産合計		70,239,017		73,882,978
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	584,048	1	548,902
器具備品	1	871,893	1	1,435,369
土地		628,433		628,433
有形固定資産合計		2,084,375		2,612,705
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		3,369,611		3,569,171
ソフトウェア仮勘定		1,374,932		1,895,190
無形固定資産合計		4,760,365		5,480,184
投資その他の資産				
投資有価証券		16,704,756		18,616,670
関係会社株式		320,136		320,136
投資不動産	1	819,255	1	814,684
長期差入保証金		565,358		538,497
前払年金費用		375,031		258,835
繰延税金資産		1,912,824		916,962
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		20,718,993		21,487,417
固定資産合計		27,563,734		29,580,307
資産合計		97,802,752		103,463,286

(単位：千円)

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	687,565	533,622
未払金		
未払収益分配金	131,478	158,856
未払償還金	395,400	133,877
未払手数料	2 4,026,078	2 5,200,810
その他未払金	2 3,818,195	2 4,412,521
未払費用	2 4,402,578	2 4,755,909
未払消費税等	629,469	752,617
未払法人税等	617,341	873,027
賞与引当金	933,517	933,381
役員賞与引当金	124,590	160,710
その他	701,285	691,143
流動負債合計	16,467,499	18,606,476
固定負債		
長期未払金	32,400	21,600
退職給付引当金	1,010,401	1,145,514
役員退職慰労引当金	130,784	117,938

時効後支払損引当金	238,811	245,426
固定負債合計	1,412,398	1,530,479
負債合計	17,879,897	20,136,956
(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	25,847,605	26,951,289
利益剰余金合計	33,188,194	34,291,879
株主資本合計	79,921,039	81,024,723

(単位：千円)

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3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	1,815	2,301,606
評価・換算差額等合計	1,815	2,301,606
純資産合計	79,922,854	83,326,329
負債純資産合計	97,802,752	103,463,286

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	67,967,489	67,963,712
投資顧問料	2,385,084	2,443,980
その他営業収益	16,085	21,613
営業収益合計	70,368,658	70,429,306
営業費用		
支払手数料	2 27,106,451	2 26,689,896
広告宣伝費	696,418	668,150
公告費	1,000	250
調査費		
調査費	1,857,271	2,077,942
委託調査費	11,579,175	12,035,954
事務委託費	847,769	798,528
営業雑経費		
通信費	153,731	296,490

印刷費	427,118	378,180
協会費	52,053	51,841
諸会費	15,990	16,613
事務機器関連費	1,953,926	1,977,769
その他営業雑経費	-	8,391
営業費用合計	44,690,907	45,000,009
一般管理費		
給料		
役員報酬	331,987	352,879
給料・手当	6,611,427	6,461,546
賞与引当金繰入	933,517	933,381
役員賞与引当金繰入	124,590	160,710
福利厚生費	1,276,950	1,272,568
交際費	11,871	2,721
旅費交通費	165,891	22,768
租税公課	360,165	402,939
不動産賃借料	647,402	666,331
退職給付費用	422,919	481,135
役員退職慰労引当金繰入	48,183	11,763
固定資産減価償却費	1,307,555	1,358,911
諸経費	427,212	413,538
一般管理費合計	12,669,674	12,541,193
営業利益	13,008,076	12,888,103

(単位：千円)

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	90,965	170,807
受取利息	2 4,169	2 2,726
投資有価証券償還益	585,179	81,557
収益分配金等時効完成分	101,734	275,835
受取賃貸料	2 65,808	2 65,808
その他	19,987	12,504
営業外収益合計	867,845	609,239
営業外費用		
投資有価証券償還損	96,379	95,946
時効後支払損引当金繰入	-	16,395
事務過誤費	3,483	-
賃貸関連費用	20,339	13,472
その他	1,920	2,932
営業外費用合計	122,122	128,747
経常利益	13,753,799	13,368,595
特別利益		
投資有価証券売却益	174,842	2,007,655
特別利益合計	174,842	2,007,655
特別損失		
投資有価証券売却損	75,963	51,737
投資有価証券評価損	163,865	26,317
固定資産除却損	1 8,832	1 536

固定資産売却損		435		-
特別損失合計		249,096		78,591
税引前当期純利益		13,679,545		15,297,659
法人税、住民税及び事業税	2	4,146,534	2	4,755,427
法人税等調整額		79,824		19,122
法人税等合計		4,226,359		4,736,304
当期純利益		9,453,186		10,561,354

（３）【株主資本等変動計算書】

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								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,069,594	33,410,184	80,143,028
当期変動額									
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

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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	25,847,605	33,188,194	79,921,039
当期変動額									
剰余金の配当							9,457,670	9,457,670	9,457,670
当期純利益							10,561,354	10,561,354	10,561,354
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)									
当期変動額合計	—	—	—	—	—	—	1,103,684	1,103,684	1,103,684
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,951,289	34,291,879	81,024,723

	評価・換算差額等	
--	----------	--

	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
当期首残高	1,815	1,815	79,922,854
当期変動額			
剰余金の配当			9,457,670
当期純利益			10,561,354
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	2,299,791	2,299,791	2,299,791
当期変動額合計	2,299,791	2,299,791	3,403,475
当期末残高	2,301,606	2,301,606	83,326,329

[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. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 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。

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、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。

5. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法に

については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5) 役員退職慰労引当金

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

(6) 時効後支払損引当金

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

6. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(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31日に公布されておりますが、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」等の適用により、翌事業年度の期首の純資産に累積的影響額が反映され、繰越利益剰余金の期首残高が475,687千円増加すると見込まれます。

- ・「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、現時点で評価中であります。

（貸借対照表関係）

1.有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
建物	599,542千円	643,920千円
器具備品	1,408,613千円	1,545,179千円
投資不動産	145,391千円	151,833千円

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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
預金	314,247千円	40,328,414千円
未収収益	15,773千円	14,138千円
未払手数料	712,210千円	772,495千円
その他未払金	3,029,426千円	3,425,136千円
未払費用	432,019千円	349,222千円

（損益計算書関係）

1.固定資産除却損の内訳

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
器具備品	8,832千円	536千円
計	8,832千円	536千円

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35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
--	--------------------------------------	-------------------------------------

支払手数料	5,234,629千円	5,128,270千円
受取利息	2千円	143千円
受取賃貸料	65,808千円	65,808千円
法人税、住民税及び事業税	3,030,180千円	3,492,898千円

（株主資本等変動計算書関係）

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。

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

(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。

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

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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。

配当金の総額	9,457,670千円
1株当たり配当額	44,700円
基準日	令和2年3月31日
効力発生日	令和2年6月29日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

令和3年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	10,576,511千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	49,988円
基準日	令和3年3月31日
効力発生日	令和3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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
1年内	675,956千円	709,808千円
1年超	—	709,808千円
合計	675,956千円	1,419,616千円

(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、金銭の信託（合同運用指定金銭信託）で運用し、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) 金銭の信託	100,000	100,000	-
(4) 未収委託者報酬	10,296,453	10,296,453	-
(5) 投資有価証券	16,673,396	16,673,396	-
資産計	85,428,625	85,428,625	-
(1) 未払手数料	4,026,078	4,026,078	-
負債計	4,026,078	4,026,078	-

第36期(令和3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	56,803,388	56,803,388	-
(2) 有価証券	2,001	2,001	-
(3) 金銭の信託	2,300,000	2,300,000	-
(4) 未収委託者報酬	13,216,357	13,216,357	-
(5) 投資有価証券	18,585,310	18,585,310	-
資産計	90,907,057	90,907,057	-
(1) 未払手数料	5,200,810	5,200,810	-
負債計	5,200,810	5,200,810	-

(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、(4) 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、(5)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。

(3)金銭の信託

時価は取引金融機関から提示された価格によっております。

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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
非上場株式	31,360	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、「(5)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	-	-	-
金銭の信託	100,000	-	-	-
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	68,755,228	5,652,257	4,813,929	27,375

第36期(令和3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	56,803,388	-	-	-
金銭の信託	2,300,000	-	-	-
未収委託者報酬	13,216,357	-	-	-
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	2,001	8,412,286	3,123,026	11,398
合計	72,321,747	8,412,286	3,123,026	11,398

(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の	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	8,874,369	10,037,087	1,162,718
	小計	8,874,369	10,037,087	1,162,718
合計		18,733,714	18,731,098	2,616

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」（貸借対照表計上額は100,000千円）を含めておりません。

非上場株式（貸借対照表計上額は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、含めておりません。

第36期(令和3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の	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	14,810,957	11,362,471	3,448,485
	小計	14,810,957	11,362,471	3,448,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えないものの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	6,076,354	6,207,447	131,093
	小計	6,076,354	6,207,447	131,093
合計		20,887,311	17,569,919	3,317,392

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」（貸借対照表計上額は2,300,000千円）を含めております。

非上場株式（貸借対照表計上額は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、含めておりません。

3.売却したその他有価証券

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

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

種類	売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他	5,747,529	2,007,655	51,737
合計	5,747,529	2,007,655	51,737

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。

当事業年度において、有価証券について26,317千円（その他有価証券のその他26,317千円）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35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,712,289 千円	3,718,736 千円
勤務費用	204,225	203,106
利息費用	17,557	19,110
数理計算上の差異の発生額	52,430	18,826
退職給付の支払額	162,904	192,890
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	3,718,736	3,729,235

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
年金資産の期首残高	2,666,937 千円	2,460,824 千円
期待運用収益	47,757	44,130
数理計算上の差異の発生額	164,633	304,281
事業主からの拠出額	51,282	-
退職給付の支払額	140,518	159,390
年金資産の期末残高	2,460,824	2,649,846

(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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	2,969,807 千円	2,810,893 千円
年金資産	2,460,824	2,649,846
	508,982	161,046
非積立型制度の退職給付債務	748,929	918,342
未積立退職給付債務	1,257,911	1,079,388
未認識数理計算上の差異	203,136	161,333
未認識過去勤務費用	419,405	354,043
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635,370	886,678
退職給付引当金	1,010,401	1,145,514
前払年金費用	375,031	258,835

貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635,370	886,678
---------------------	---------	---------

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
勤務費用	204,225 千円	203,106 千円
利息費用	17,557	19,110
期待運用収益	47,757	44,130
数理計算上の差異の費用処理額	24,035	41,361
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	6,427	44,446
確定給付制度に係る退職給付費用	269,848	329,255

(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、再就職支援金及び退職金です。

(5)年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
債券	64.7 %	62.7 %
株式	32.3	35.4
その他	3.0	1.9
合計	100	100

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
割引率	0.095～0.52%	0.051～0.59%
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153,070千円、当事業年度151,880千円であります。

(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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	427,046千円	418,394千円
投資有価証券評価損	226,322	188,859
未払事業税	117,461	180,263
賞与引当金	285,842	285,801
役員賞与引当金	19,703	25,472
役員退職慰労引当金	40,046	36,112
退職給付引当金	309,384	350,756

減価償却超過額	96,767	68,024
委託者報酬	213,044	209,938
長期差入保証金	40,180	48,639
時効後支払損引当金	73,124	75,149
連結納税適用による時価評価	57,656	38,873
その他	123,248	87,023
繰延税金資産 小計	2,029,829	2,013,308
評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	2,029,829	2,013,308
繰延税金負債		
前払年金費用	114,834	79,225
連結納税適用による時価評価	1,260	1,203
その他有価証券評価差額金	801	1,015,785
その他	109	101
繰延税金負債 合計	117,005	1,096,346
繰延税金資産の純額	1,912,824	916,962

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35期（令和2年3月31日現在）及び第36期（令和3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35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）及び第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）及び第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,234,629 千円	未払手数料	712,210 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 (注3)	583,270 千円	未払費用	302,681 千円

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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)	3,492,898 千円	その他未払金	3,425,136 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	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,128,270 千円	未払手数料	772,495 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 (注3)	523,327 千円	未払費用	290,120 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3)	科目	期末残高 (注3)
----	--------	-----	-----	-------	------------------------	---------------	-------	--------------	----	--------------

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1）	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2）	20,000,000 千円		
							コーラブル預金の預入（注2）	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2）	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1）	5,714,501 千円	未払手数料	944,351 千円

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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3）	科目	期末残高（注3）
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1）	3,729,785 千円	未払手数料	764,501 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1）	5,655,482 千円	未払手数料	1,193,245 千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

- （注）1．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。
- 2．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。
- 3．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35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
１株当たり純資産額	377,741.17円	393,827.09円
１株当たり当期純利益金額	44,678.80円	49,916.36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35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
当期純利益金額（千円）	9,453,186	10,561,354
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）	9,453,186	10,561,354
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581	211,581

４【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

５【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

名称：三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

（再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）

資本金の額：324,279百万円（2021年３月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

（２）販売会社

名称	資本金の額 (2021年３月末現在)	事業の内容
株式会社三菱ＵＦＪ銀行	1,711,958 百万円	銀行業務を営んでいます。
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。
損保ジャパンＤＣ証券株式会社	3,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

（３）再委託先

名称：ブラックロック・インベストメント・マネジメント（ＵＫ）リミテッド

資本金の額：94百万英ポンド（2021年７月末現在）

事業の内容：投資運用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）再委託先：委託会社から外国株式マザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受け、運用の指図を行います。

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7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10月21日	有価証券届出書
2020年10月21日	有価証券報告書
2021年４月21日	有価証券届出書の訂正届出書
2021年４月21日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

令和3年6月28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3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９月１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 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 和田 渉
業務執行社員

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」に掲げられている三菱ＵＦＪ ＤＣ金利連動アロケーション型バランスファンドの令和２年７月23日から令和３年７月26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、三菱ＵＦＪ ＤＣ金利連動アロケーション型バランスファンドの令和３年７月26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、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、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。