

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年11月4日提出
【発行者名】	三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 横川 直
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目１２番１号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【電話番号】	03-6250-4740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	国内債券セレクション（ラップ向け）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	１兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2021年4月30日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について半期報告書の提出に伴う関係情報の更新等を行うため、本訂正届出書を提出します。

2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部__は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書の更新後の内容を示します。

「第二部 ファンド情報 第1 ファンド状況 5 運用状況」は原届出書の更新後の内容を記載します。

なお、「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」において、「1 財務諸表」につきましては「中間財務諸表」が追加され、「2 ファンドの現況」につきましては原届出書の更新後の内容を記載します。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

当ファンドは、主として利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざして運用を行います。
信託金の限度額は、5,000億円です。

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

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

商品分類表

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

属性区分表

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

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

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

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

商品分類の定義

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

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

属性区分の定義

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

	公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（ＢＢ格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（ＢＢ格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。
	決算頻度	
	年１回	信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年２回	信託約款において、年２回決算する旨の記載があるものをいいます。
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

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

ファンドの特色

特色1

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

- 投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。なお、2021年11月5日現在、投資対象となっている投資信託証券は以下の通りです。

<日本債券インデックスマザーファンド>

日本の公社債への投資を行います。

- ・NOMURA-BPI総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・NOMURA-BPI総合をベンチマークとします。
- ・対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の実質投資比率が100%を超える場合があります。

<先進国高格付国債マザーファンド>

日本を含む先進国の国債等への投資を行います。

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

① 運用の指図に関する権限の委託を受ける者、委託の内容、委託の有無等については、変更する場合があります。

<MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド>

世界主要国(日本を除く)の公社債への投資を行います。

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

<ショートデュレーション円インカムマザーファンド>

日本を含む先進国の債券等への投資を行います。

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

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

<格付けとは>

		S&P	Moody's	Fitch	
低い	高い	AAA	Aaa	AAA	投資適格 格付け
		AA	Aa	AA	
		A	A	A	
		BBB	Baa	BBB	
利回り	信用力	BB	Ba	BB	投機的 格付け
		B	B	B	
		CCC	Caa	CCC	
		CC	Ca	CC	
高い	低い	C	C	C	
		D	-	D	

S&Pグローバル・レーティング(S&P)のAAからCCCまでおよびフィッチ・レーティング(Fitch)のAAからBまでの格付けには「+」、「-」、ムーディーズ・インベスターズ・サービス(Moody's)のAaからCaaまでの格付けには「1」、「2」、「3」という付加記号が付されることがあります。

左記は格付けと利回りの間の一般的な関係を示したイメージ図であり、利回りは格付け以外の要因によっても変動するため、この関係通りの利回りが成立しない場合があります。

<三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド>

日本の公社債を主要投資対象とします。

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

<フランス国債7-10年ラダーマザーファンド>

フランスの国債を主要投資対象とします。

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

<ヘッジ付スペイン国債7-10年ラダーマザーファンド>

スペインの国債を主要投資対象とします。

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

<日本超長期国債インデックスマザーファンド>

日本の国債を主要投資対象とします。

- ・NOMURA-BPI国債 超長期(11-)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・NOMURA-BPI国債 超長期(11-)をベンチマークとします。
- ・対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し債券の実質投資比率が100%を超える場合があります。

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

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

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

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

AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッド

AMPCAPITAL 

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

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

特色2

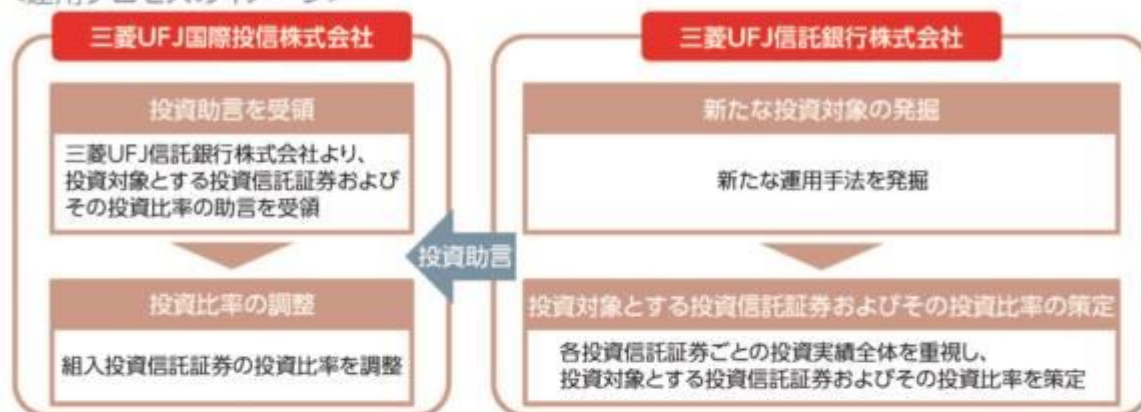
三菱UFJ信託銀行からの投資助言に基づき運用を行います。

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

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

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

<運用プロセスのイメージ>



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

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

特色3

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。ただし、為替ヘッジにより、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。

為替ヘッジの活用

為替予約取引を活用し為替ヘッジを行うことにより、為替ヘッジをしなかった場合と比較して安定した値動きが期待されます。ただし、為替ヘッジにより、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。なお、為替ヘッジを行うにあたっては、対象通貨間の金利差に基づくヘッジコストがかかります。

！ 為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。

<投資リターンのイメージ図>



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

特色4

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

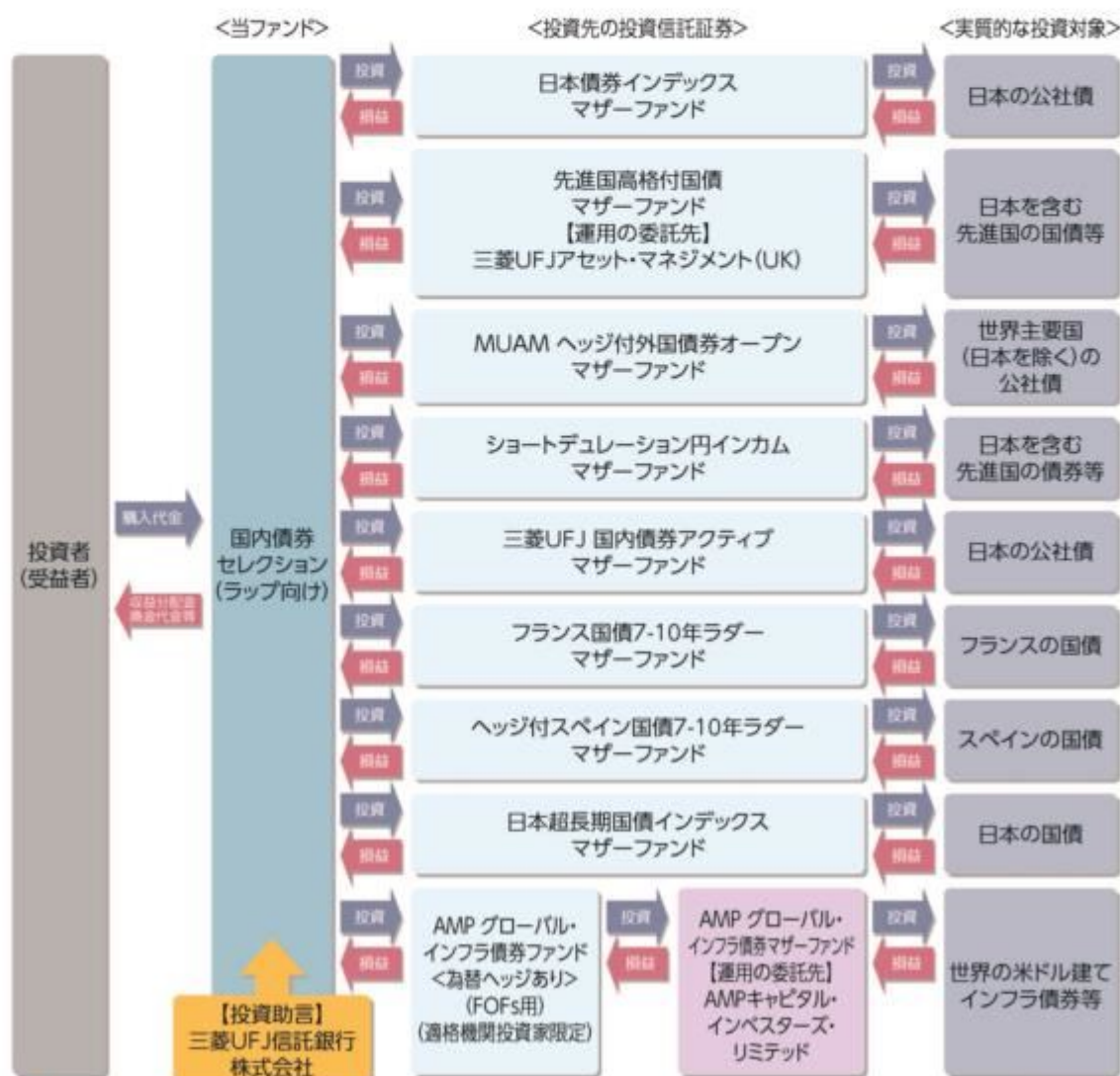
- 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ファンドの仕組み

ファンド・オブ・ファンズ方式により運用を行います。



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

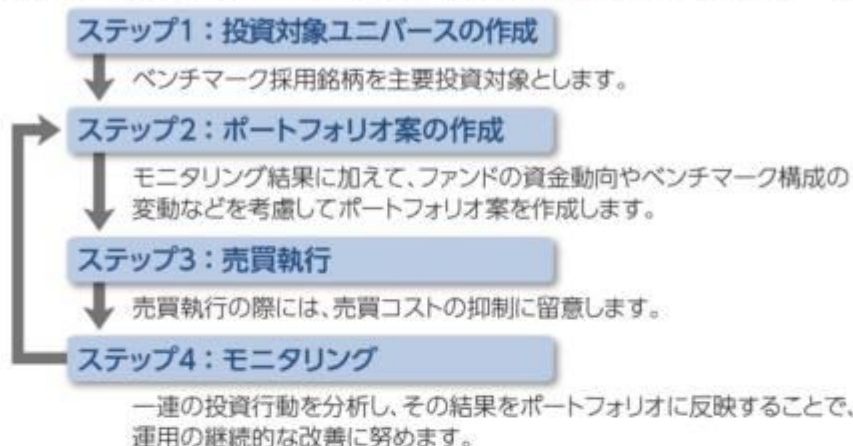
❗ 上記の投資対象とする投資信託証券は、今後変更される場合があります。

■主な投資制限

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

■各投資信託証券の運用プロセス

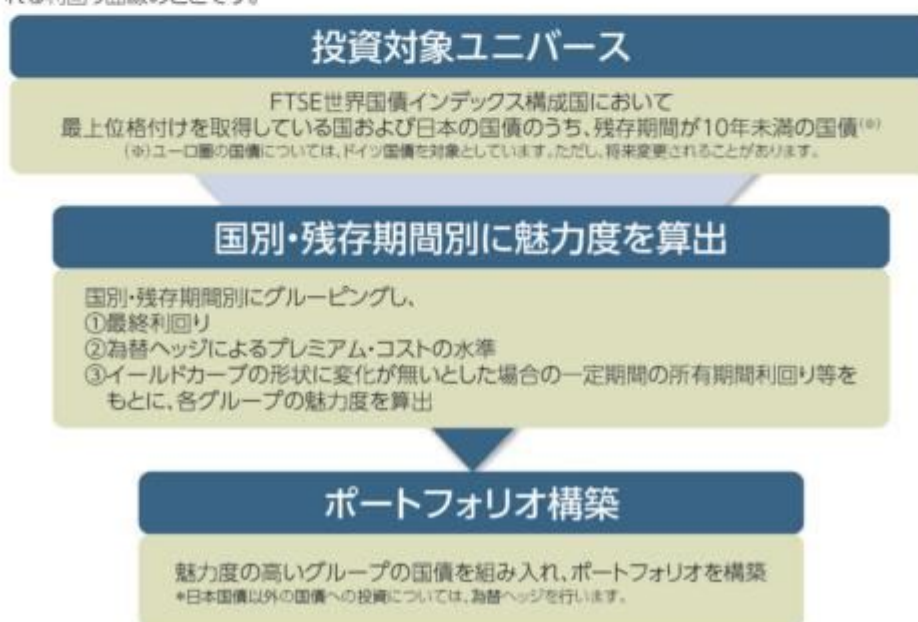
<日本債券インデックスマザーファンド／日本超長期国債インデックスマザーファンド>



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

<先進国高格付国債マザーファンド>

- 銘柄選定にあたっては、最終利回り、イールドカーブおよび為替ヘッジコスト等を勘案して決定します。
- ❑ イールドカーブとは、同種類の債券の償還までの残存期間を横軸にとり、それに対応した利回りを縦軸にとった時に描かれる利回り曲線のことです。

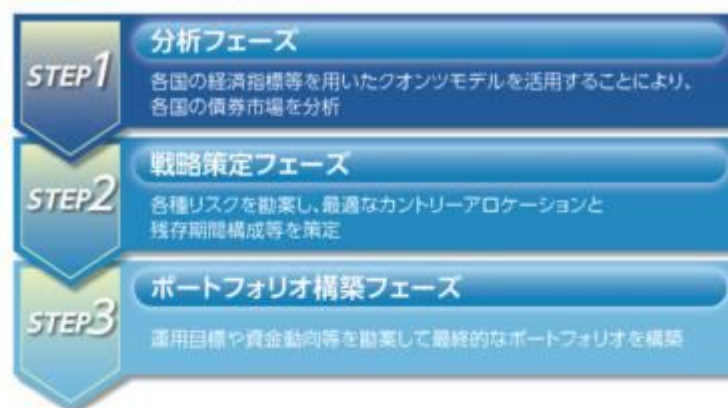


❗ 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

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

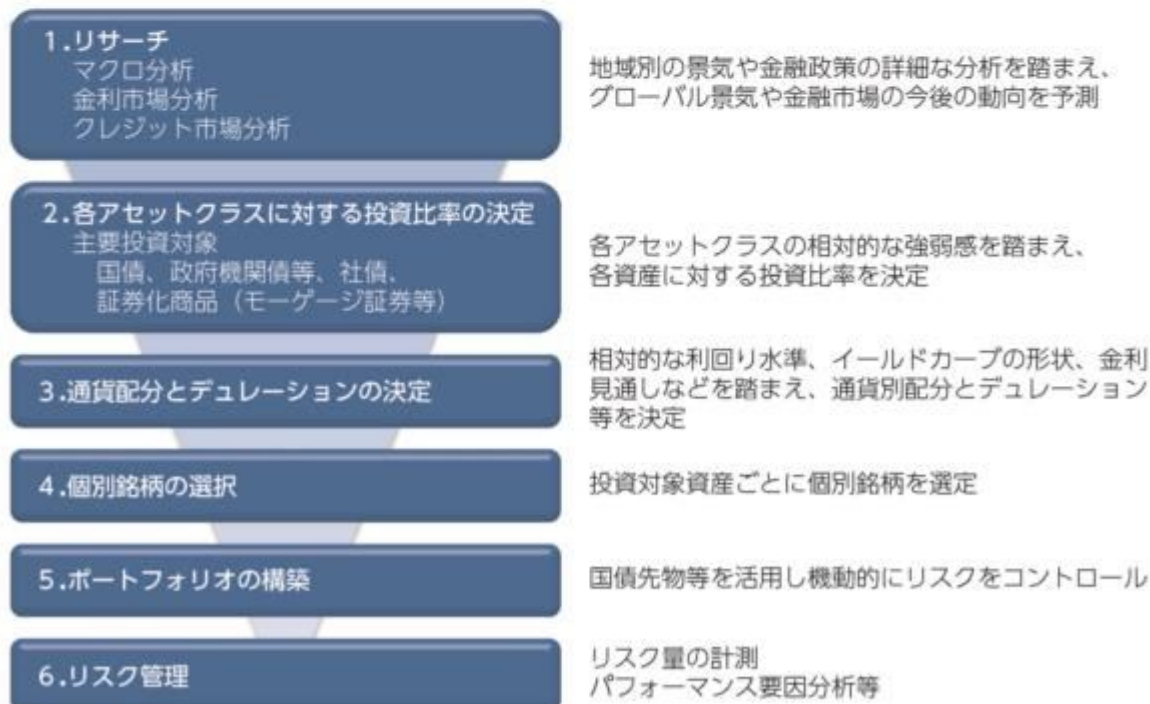
<MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド>

- FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)をベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。
・運用にあたっては、クオンツモデルを活用します。



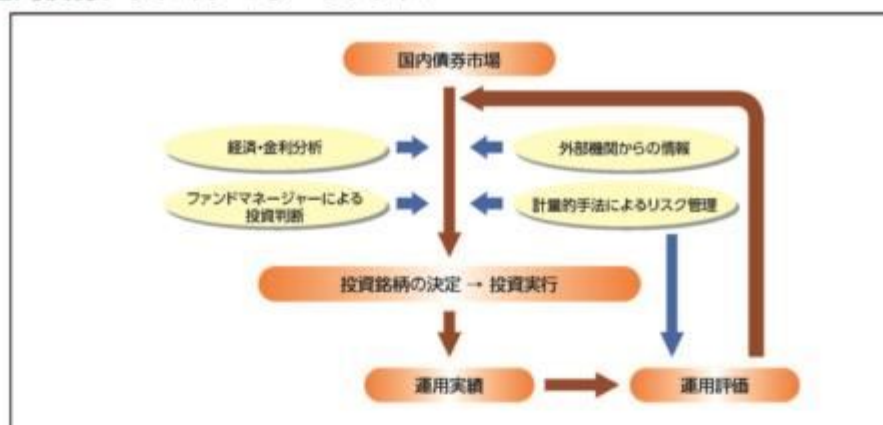
- ！ 上図はポートフォリオ構築プロセスのイメージであり、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。
- ！ 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。

<ショートデュレーション円インカムマザーファンド>



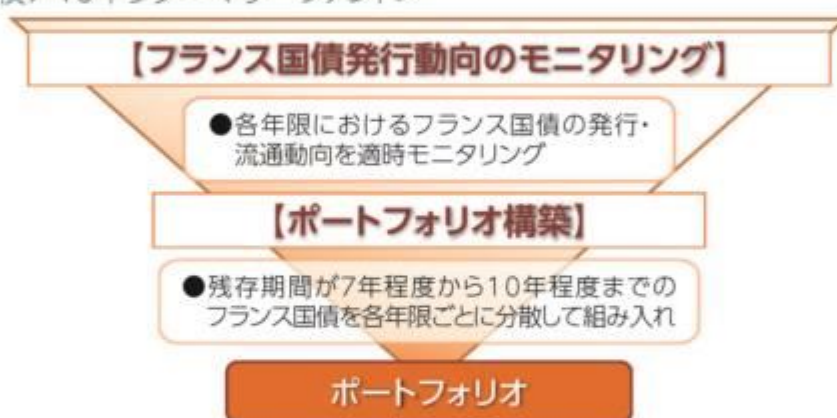
- イールドカーブとは、同種類の債券の償還までの残存期間を横軸にとり、それに対応した利回りを縦軸にとった時に描かれる利回り曲線のことです。
- ！ 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、すべてを網羅するものではありません。また、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。上記のプロセスは、今後変更されることがあります。

<三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド>



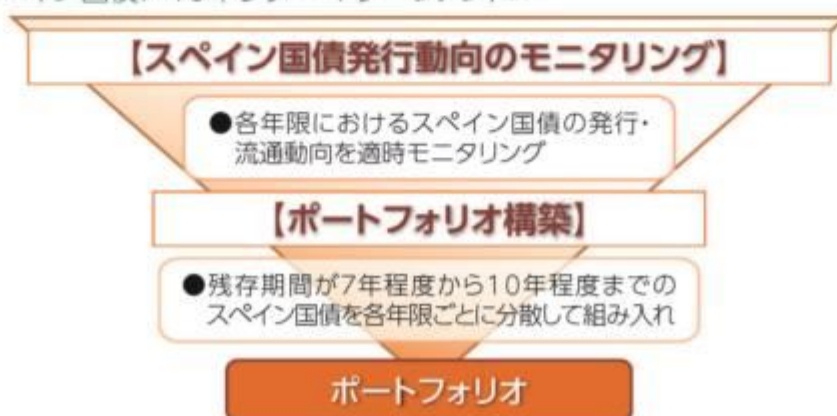
❗ 上記の運用プロセスは銘柄選定等の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄が常に上記の条件を満たすわけではありません。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。なお、今後、変更される場合があります。

<フランス国債7-10年ラダーマザーファンド>



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

<ヘッジ付スペイン国債7-10年ラダーマザーファンド>



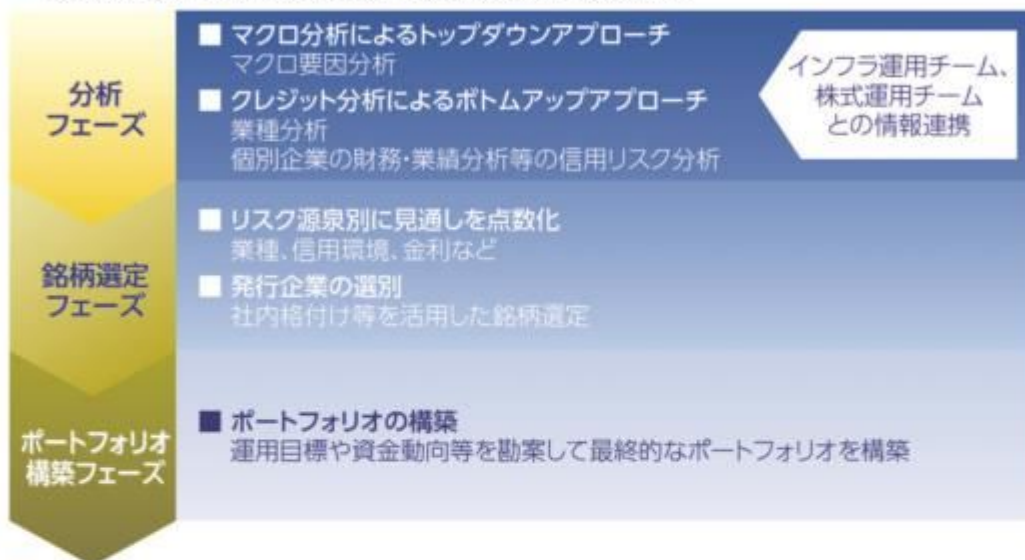
❗ 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、すべてを網羅するものではありません。また、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。上記のプロセスは、今後変更されることがあります。

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

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

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

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



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

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

<格付けとは>

低い	高い	S&P	Moody's	Fitch	
↑	↑	AAA	Aaa	AAA	投資適格格付け
		AA	Aa	AA	
		A	A	A	
		BBB	Baa	BBB	投機的格付け
		BB	Ba	BB	
		B	B	B	
		CCC	Caa	CCC	
		CC	Ca	CC	
		C	C	C	
		D	—	D	
高い	低い				

利回り ↑ 信用力 ↓

S&Pグローバル・レーティング(S&P)のAAからCCCまでおよびフィッチ・レーティング(Fitch)のAAからBまでの格付けには「+」、「-」、ムーディーズ・インベスターズ・サービス(Moody's)のAaからCaaまでの格付けには「1, 2, 3」という付加記号が付されることがあります。

左記は格付けと利回りの間の一般的な関係を示したイメージ図であり、利回りは格付け以外の要因によっても変動するため、この関係通りの利回りが成立しない場合があります。



指数について

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

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

・NOMURA-BPI国債 超長期(11-)とは、野村證券株式会社が発表している日本国が発行した固定利付債(個人向けは対象外)の残存期間11年以上の債券のパフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI国債のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（３）【ファンドの仕組み】

<訂正前>

委託会社と関係法人との契約の概要

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

委託会社の概況（2021年2月末現在）

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

・大株主の状況

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

<訂正後>

委託会社と関係法人との契約の概要

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

委託会社の概況（2021年8月末現在）

- ・金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号

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

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

3【投資リスク】

<更新後>

(1) 投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

（主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。）

価格変動 リスク

一般に、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動するため、ファンドはその影響を受け組入公社債の価格の下落は基準価額の下落要因となります。

為替変動 リスク

組入外貨建資産については、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図りますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。為替ヘッジを行う場合で円金利がヘッジ対象通貨建の金利より低いときには、これらの金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。

信用リスク

組入有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等には、当該組入有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払い・償還金の支払いが滞ることがあります。

流動性 リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合または取引が不可能となる場合、市場実勢から期待される価格より不利な価格での取引となる可能性があります。

留意事項

- ・ 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオ

フ)の適用はありません。

- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。

(2) 投資リスクに対する管理体制

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

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

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

トレーディング担当部署

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

コンプライアンス担当部署

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

リスク管理担当部署

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

内部監査担当部署

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

< 流動性リスクに対する管理体制 >

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

* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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



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

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4【手数料等及び税金】

(3)【信託報酬等】

<更新後>

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年0.385%（税抜0.35%）の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

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

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

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.28%	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等
販売会社	0.04%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等
受託会社	0.03%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

受益者が負担する実質的な信託報酬率（概算値）は、次の通りとなります。

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

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

（注）上記概算値は、投資対象とする投資信託証券における信託報酬率を含めた実質的な信託報酬率を算出したものです（2021年11月5日現在）。各投資信託証券への投資比率が変動する可能性や投資信託証券の変更の可能性があること、また別途成功報酬がかかる投資信託証券が含まれる場合があることから、実質的な信託報酬率は変動します。したがって事前に固定の料率、上限額等を表示することはできません。

< 投資信託証券の信託報酬率 >

投資信託証券の名称	信託報酬率（税抜）
日本債券インデックスマザーファンド	-
先進国高格付国債マザーファンド	- 外部委託報酬：純資産総額の年0.125%以内
MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド	-
ショートデュレーション円インカムマザーファンド	-
三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド	-
フランス国債7-10年ラダーマザーファンド	-
ヘッジ付スペイン国債7-10年ラダーマザーファンド	-
日本超長期国債インデックスマザーファンド	-
AMP グローバル・インフラ債券ファンド＜為替ヘッジあり＞（FOFs用） （適格機関投資家限定）	年0.336% 外部委託報酬：マザーファンドの純資産総額の年0.33%
AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド	-

上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかる場合があります。

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

（５）【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

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

１．収益分配金の課税

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

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

２．解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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2月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

< 訂正後 >

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

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

１．収益分配金の課税

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

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

２．解約時および償還時の課税

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

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

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

解約時および償還時の損失（譲渡損）については、確定申告により収益分配金を含む上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限りまゝ。）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8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】

【国内債券セクション（ラップ向け）】

（１）【投資状況】

令和 3年 8月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	4,649,742,216	13.65
親投資信託受益証券	日本	28,450,947,595	83.55
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	952,648,806	2.80
純資産総額		34,053,338,617	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 8月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	ショートデュレーション円インカムマザーファンド	7,774,772,371	0.9701	7,542,471,020	0.9688	7,532,199,473	22.12
日本	親投資信託受益証券	三菱ＵＦＪ 国内債券アクティブマザーファンド	4,485,814,183	1.4657	6,575,252,867	1.4752	6,617,473,082	19.43
日本	親投資信託受益証券	日本超長期国債インデックスマザーファンド	4,864,133,172	1.0122	4,923,720,000	1.0204	4,963,361,488	14.58
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	3,671,905,852	1.3445	4,936,992,105	1.3515	4,962,580,758	14.57
日本	投資信託受益証券	ＡＭＰ グローバル・インフラ債券ファンド＜為替ヘッジあり＞（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	3,912,277,843	1.1615	4,544,320,506	1.1885	4,649,742,216	13.65
日本	親投資信託受益証券	ＭＵＡＭ ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド	1,345,373,399	1.7638	2,373,024,616	1.7802	2,395,033,724	7.03
日本	親投資信託受益証券	先進国高格付国債マザーファンド	574,910,941	1.1515	662,010,501	1.1503	661,320,055	1.94
日本	親投資信託受益証券	フランス国債 7 - 10 年ラダーマザーファンド	575,064,579	1.1432	657,437,243	1.1476	659,944,110	1.94
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付スペイン国債 7 - 10 年ラダーマザーファンド	599,286,083	1.0898	653,116,327	1.0997	659,034,905	1.94

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 3年 8月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	13.65
親投資信託受益証券	83.55
合計	97.20

（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8月末日、同日前１年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

	純資産総額		基準価額 （１万口当たりの純資産価額）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間末日（平成30年 2月 5日）	11,105,960,848	11,105,960,848	10,075	10,075
第2計算期間末日（平成31年 2月 5日）	16,779,646,867	16,779,646,867	10,153	10,153
第3計算期間末日（令和 2年 2月 5日）	19,288,687,531	19,288,687,531	10,452	10,452
第4計算期間末日（令和 3年 2月 5日）	24,115,146,293	24,115,146,293	10,473	10,473
令和 2年 8月末日	18,268,850,833	—	10,449	—
9月末日	18,961,334,925	—	10,482	—
10月末日	20,565,361,700	—	10,469	—
11月末日	21,867,470,967	—	10,521	—
12月末日	22,746,164,930	—	10,524	—
令和 3年 1月末日	23,954,316,574	—	10,488	—
2月末日	24,244,203,634	—	10,358	—
3月末日	25,443,329,610	—	10,385	—
4月末日	26,751,243,728	—	10,402	—
5月末日	28,966,141,412	—	10,416	—
6月末日	30,872,839,456	—	10,448	—

7月末日	32,656,247,650	—	10,524	—
8月末日	34,053,338,617	—	10,514	—

【分配の推移】

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

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	0.75
第2計算期間	0.77
第3計算期間	2.94
第4計算期間	0.20
第5中間計算期間	0.65

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	12,571,701,220	1,548,474,323	11,023,226,897
第2計算期間	8,904,288,458	3,400,559,093	16,526,956,262
第3計算期間	5,442,609,493	3,515,542,243	18,454,023,512
第4計算期間	11,312,543,909	6,741,276,409	23,025,291,012
第5中間計算期間	10,320,402,287	2,040,077,234	31,305,616,065

（参考）

日本債券インデックスマザーファンド

投資状況

令和 3年 8月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
-------	------	------	---------

国債証券	日本	274,893,924,650	83.23
地方債証券	日本	17,936,202,932	5.43
特殊債券	日本	18,966,906,060	5.74
社債券	日本	16,140,769,000	4.89
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	2,360,597,602	0.71
純資産総額		330,298,400,244	100.00

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

その他の資産の投資状況

令和 3年 8月31日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
債券先物取引	買建	日本	1,217,280,000	0.37

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 3 0 銘柄

令和 3年 8月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (％)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (％)
日本	国債証券	第 1 4 4 回利付国債（ 5 年）	4,180,000,000	100.92	4,218,456,000	100.87	4,216,700,400	0.100000	2025/6/20	1.28
日本	国債証券	第 3 5 9 回利付国債（ 1 0 年）	4,090,000,000	100.67	4,117,479,000	101.28	4,142,392,900	0.100000	2030/6/20	1.25
日本	国債証券	第 1 3 8 回利付国債（ 5 年）	3,830,000,000	100.63	3,854,420,000	100.54	3,850,758,600	0.100000	2023/12/20	1.17
日本	国債証券	第 1 3 4 回利付国債（ 5 年）	3,740,000,000	100.37	3,753,838,000	100.29	3,751,182,600	0.100000	2022/12/20	1.14
日本	国債証券	第 3 5 6 回利付国債（ 1 0 年）	3,450,000,000	100.85	3,479,613,000	101.41	3,498,886,500	0.100000	2029/9/20	1.06
日本	国債証券	第 3 3 3 回利付国債（ 1 0 年）	3,250,000,000	102.13	3,319,322,500	101.86	3,310,645,000	0.600000	2024/3/20	1.00
日本	国債証券	第 3 4 8 回利付国債（ 1 0 年）	3,210,000,000	101.05	3,243,715,500	101.34	3,253,046,100	0.100000	2027/9/20	0.98
日本	国債証券	第 3 2 9 回利付国債（ 1 0 年）	3,160,000,000	101.97	3,222,315,200	101.66	3,212,708,800	0.800000	2023/6/20	0.97
日本	国債証券	第 3 6 0 回利付国債（ 1 0 年）	2,950,000,000	100.47	2,963,947,500	101.17	2,984,780,500	0.100000	2030/9/20	0.90
日本	国債証券	第 3 5 8 回利付国債（ 1 0 年）	2,920,000,000	100.61	2,937,975,600	101.33	2,958,865,200	0.100000	2030/3/20	0.90
日本	国債証券	第 3 6 2 回利付国債（ 1 0 年）	2,870,000,000	100.27	2,877,975,200	100.90	2,896,002,200	0.100000	2031/3/20	0.88
日本	国債証券	第 3 4 6 回利付国債（ 1 0 年）	2,860,000,000	101.02	2,889,417,000	101.22	2,895,120,800	0.100000	2027/3/20	0.88
日本	国債証券	第 3 3 4 回利付国債（ 1 0 年）	2,830,000,000	102.30	2,895,288,100	102.06	2,888,439,500	0.600000	2024/6/20	0.87

日本	国債証券	第３４５回利付国債（１０年）	2,850,000,000	101.01	2,878,870,500	101.17	2,883,430,500	0.100000	2026/12/20	0.87
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	2,740,000,000	100.91	2,765,043,600	101.47	2,780,305,400	0.100000	2028/12/20	0.84
日本	国債証券	第３５５回利付国債（１０年）	2,740,000,000	100.94	2,765,939,500	101.45	2,779,784,800	0.100000	2029/6/20	0.84
日本	国債証券	第３６１回利付国債（１０年）	2,700,000,000	100.37	2,710,099,500	101.02	2,727,648,000	0.100000	2030/12/20	0.83
日本	国債証券	第４２３回利付国債（２年）	2,650,000,000	100.25	2,656,865,000	100.22	2,656,068,500	0.005000	2023/4/1	0.80
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	2,570,000,000	101.05	2,597,062,700	101.38	2,605,594,500	0.100000	2028/3/20	0.79
日本	国債証券	第３４７回利付国債（１０年）	2,550,000,000	101.04	2,576,681,000	101.28	2,582,742,000	0.100000	2027/6/20	0.78
日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	2,480,000,000	100.99	2,504,676,000	101.11	2,507,726,400	0.100000	2026/9/20	0.76
日本	国債証券	第１４７回利付国債（５年）	2,490,000,000	100.52	2,503,070,500	100.59	2,504,790,600	0.005000	2026/3/20	0.76
日本	国債証券	第３３５回利付国債（１０年）	2,370,000,000	102.14	2,420,718,000	101.93	2,415,741,000	0.500000	2024/9/20	0.73
日本	国債証券	第１４６回利付国債（５年）	2,390,000,000	100.95	2,412,897,200	100.99	2,413,756,600	0.100000	2025/12/20	0.73
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	2,350,000,000	100.96	2,372,587,000	101.48	2,384,827,000	0.100000	2029/3/20	0.72
日本	国債証券	第１４３回利付国債（５年）	2,310,000,000	100.87	2,330,137,000	100.81	2,328,918,900	0.100000	2025/3/20	0.71
日本	国債証券	第３３６回利付国債（１０年）	2,280,000,000	102.28	2,332,029,600	102.08	2,327,606,400	0.500000	2024/12/20	0.70
日本	国債証券	第３４９回利付国債（１０年）	2,170,000,000	101.12	2,194,316,000	101.36	2,199,598,800	0.100000	2027/12/20	0.67
日本	国債証券	第３６３回利付国債（１０年）	2,170,000,000	100.80	2,187,474,400	100.78	2,186,969,400	0.100000	2031/6/20	0.66
日本	国債証券	第１４０回利付国債（５年）	2,160,000,000	100.70	2,175,276,000	100.66	2,174,256,000	0.100000	2024/6/20	0.66

（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 8月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	83.23
地方債証券	5.43
特殊債券	5.74
社債券	4.89
合計	99.29

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

令和 3年 8月31日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物２１年０９月限	買建	8	円	1,212,518,800	1,217,280,000	0.37

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

先進国高格付国債マザーファンド

投資状況

令和 3年 8月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	シンガポール	38,178,101,808	38.28
	オーストラリア	37,702,144,370	37.81
	カナダ	18,828,689,871	18.88
	小計	94,708,936,049	94.97
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	5,014,783,699	5.03
純資産総額		99,723,719,748	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

令和 3年 8月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (％)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (％)
カナダ	国債証券	1.25 CAN GOVT 300601	162,000,000	9,048.96	14,659,326,329	8,806.85	14,267,106,882	1.250000	2030/6/1	14.31
シンガ ポール	国債証券	2.875 SINGAPORGOV 290701	153,000,000	9,524.04	14,571,790,464	9,176.74	14,040,415,872	2.875000	2029/7/1	14.08
オースト ラリア	国債証券	4.75 AUST GOVT 270421	128,000,000	10,149.18	12,990,956,032	9,836.76	12,591,064,889	4.750000	2027/4/21	12.63
オースト ラリア	国債証券	3.25 AUST GOVT 290421	102,000,000	9,609.57	9,801,764,460	9,412.10	9,600,342,085	3.250000	2029/4/21	9.63
シンガ ポール	国債証券	3.5 SINGAPORGOV 270301	103,000,000	9,314.84	9,594,291,537	9,282.21	9,560,679,184	3.500000	2027/3/1	9.59
シンガ ポール	国債証券	2.625 SINGAPORGOV 280501	106,000,000	9,087.79	9,633,058,859	8,966.61	9,504,616,352	2.625000	2028/5/1	9.53
オースト ラリア	国債証券	2.5 AUST GOVT 300521	101,000,000	9,107.91	9,198,991,313	9,012.53	9,102,665,290	2.500000	2030/5/21	9.13
オースト ラリア	国債証券	2.25 AUST GOVT 280521	73,000,000	8,672.41	6,330,866,070	8,778.18	6,408,072,106	2.250000	2028/5/21	6.43
シンガ ポール	国債証券	2.875SINGAPORGOV 300901	55,000,000	9,208.45	5,064,650,999	9,222.52	5,072,390,400	2.875000	2030/9/1	5.09
カナダ	国債証券	2.25 CAN GOVT 290601	48,000,000	9,833.13	4,719,904,559	9,503.29	4,561,582,989	2.250000	2029/6/1	4.57

（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 8月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	94.97
合計	94.97

（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。

M U A M ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド

投資状況

令和 3年 8月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国 / 地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	72,784,724,375	46.20
	イタリア	15,526,700,707	9.85
	フランス	14,561,517,437	9.24
	ドイツ	10,871,504,483	6.90
	イギリス	10,354,911,933	6.57
	スペイン	10,226,197,713	6.49
	アイルランド	3,593,908,958	2.28
	カナダ	3,297,644,369	2.09
	オランダ	3,159,053,266	2.01
	オーストリア	3,154,105,097	2.00
	オーストラリア	3,148,549,399	2.00
	ベルギー	2,769,685,752	1.76
	フィンランド	1,195,375,626	0.76
	ポーランド	1,020,107,231	0.65
	スウェーデン	477,501,455	0.30
	小計	156,141,487,801	99.11
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	1,410,041,219	0.89
純資産総額		157,551,529,020	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 8月31日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	1.375 T-BOND 401115	114,900,000	9,676.74	11,118,574,752	10,217.26	11,739,638,202	1.375000	2040/11/15	7.45
アメリカ	国債証券	0.25 T-NOTE 250731	88,900,000	10,845.83	9,641,943,844	10,841.89	9,638,442,496	0.250000	2025/7/31	6.12
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 280331	63,100,000	11,036.54	6,964,057,769	11,148.41	7,034,647,050	1.250000	2028/3/31	4.46
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 230215	59,700,000	11,217.52	6,696,863,824	11,187.04	6,678,667,214	1.375000	2023/2/15	4.24
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 250131	56,000,000	11,338.38	6,349,494,480	11,315.40	6,336,627,937	1.375000	2025/1/31	4.02
アメリカ	国債証券	0.125 T-NOTE 231215	55,900,000	10,964.41	6,129,108,833	10,953.08	6,122,771,982	0.125000	2023/12/15	3.89
イギリス	国債証券	1.25 GILT 411022	30,000,000	15,160.58	4,548,175,793	15,831.79	4,749,539,156	1.250000	2041/10/22	3.01
イタリア	国債証券	0.6 ITALY GOVT 230615	34,350,000	13,227.08	4,543,503,045	13,227.24	4,543,559,176	0.600000	2023/6/15	2.88
アメリカ	国債証券	0.125 T-NOTE 230915	38,200,000	10,972.39	4,191,456,350	10,969.82	4,190,472,401	0.125000	2023/9/15	2.66
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300515	37,600,000	10,272.10	3,862,313,322	10,457.67	3,932,084,625	0.625000	2030/5/15	2.50
アメリカ	国債証券	1.25 T-BOND 500515	40,800,000	8,721.81	3,558,500,935	9,374.98	3,824,993,944	1.250000	2050/5/15	2.43
フランス	国債証券	4.5 O.A.T 410425	16,160,000	22,499.93	3,635,989,644	23,136.66	3,738,884,624	4.500000	2041/4/25	2.37
アメリカ	国債証券	3.125 T-NOTE 281115	27,200,000	12,450.03	3,386,410,517	12,553.49	3,414,551,788	3.125000	2028/11/15	2.17
フランス	国債証券	0.5 O.A.T 400525	25,850,000	12,704.59	3,284,138,729	13,201.54	3,412,599,936	0.500000	2040/5/25	2.17
カナダ	国債証券	2.25 CAN GOVT 290601	34,700,000	9,530.20	3,306,979,781	9,503.29	3,297,644,369	2.250000	2029/6/1	2.09
スペイン	国債証券	1.3 SPAIN GOVT 261031	22,360,000	14,048.38	3,141,219,220	14,092.84	3,151,159,396	1.300000	2026/10/31	2.00
オースト ラリア	国債証券	2.75 AUST GOVT 291121	34,200,000	9,150.54	3,129,485,534	9,151.24	3,129,725,199	2.750000	2029/11/21	1.99
フランス	国債証券	1.75 O.A.T 230525	22,890,000	13,560.38	3,103,972,447	13,525.60	3,096,010,651	1.750000	2023/5/25	1.97
アメリカ	国債証券	0.25 T-NOTE 230615	27,400,000	11,008.68	3,016,379,142	11,000.73	3,014,200,681	0.250000	2023/6/15	1.91
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 231231	25,200,000	11,549.80	2,910,550,388	11,496.99	2,897,243,900	2.250000	2023/12/31	1.84
イタリア	国債証券	5 ITALY GOVT 390801	12,860,000	20,561.05	2,644,151,364	20,858.93	2,682,459,370	5.000000	2039/8/1	1.70
ドイツ	国債証券	0 BUND 271115	19,050,000	13,392.43	2,551,258,619	13,527.80	2,577,047,475	0.000000	2027/11/15	1.64
フランス	国債証券	0 O.A.T 260225	19,280,000	13,312.56	2,566,662,887	13,314.62	2,567,059,479	0.000000	2026/2/25	1.63
スペイン	国債証券	0 SPAIN GOVT 250131	18,520,000	13,164.87	2,438,134,806	13,191.91	2,443,141,950	0.000000	2025/1/31	1.55
イタリア	国債証券	3.1 ITALY GOVT 400301	14,330,000	16,547.26	2,371,223,454	16,874.76	2,418,154,537	3.100000	2040/3/1	1.53
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 270131	20,800,000	11,347.17	2,360,212,399	11,375.50	2,366,105,787	1.500000	2027/1/31	1.50

オランダ	国債証券	0.5 NETH GOVT 260715	16,080,000	13,666.73	2,197,610,940	13,728.52	2,207,547,541	0.500000	2026/7/15	1.40
ドイツ	国債証券	0 BUND 310215	16,250,000	13,291.92	2,159,938,316	13,574.23	2,205,813,560	0.000000	2031/2/15	1.40
ドイツ	国債証券	2.5 BUND 440704	9,260,000	19,863.32	1,839,343,469	20,870.72	1,932,629,263	2.500000	2044/7/4	1.23
スペイン	国債証券	1.2 SPAIN GOVT 401031	13,730,000	13,224.72	1,815,754,752	13,686.98	1,879,223,697	1.200000	2040/10/31	1.19

（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 8月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	99.11
合計	99.11

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ショートデュレーション円インカムマザーファンド

投資状況

令和 3年 8月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国 / 地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	日本	1,140,349,800	13.70
	フランス	229,935,260	2.76
	アメリカ	109,921,464	1.32
	小計	1,480,206,524	17.78
地方債証券	カナダ	92,027,785	1.11
特殊債券	カナダ	413,062,371	4.96
	ドイツ	332,324,270	3.99
	アメリカ	137,526,587	1.65
	オーストラリア	134,469,882	1.62
	小計	1,017,383,110	12.22
社債券	オーストラリア	1,102,356,705	13.24
	イギリス	600,566,213	7.21
	アメリカ	586,457,383	7.04

	スウェーデン	372,430,917	4.47
	カナダ	180,389,257	2.17
	アイルランド	161,601,132	1.94
	ドイツ	133,285,785	1.60
	日本	101,947,000	1.22
	小計	3,239,034,392	38.90
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	2,496,908,948	29.99
純資産総額		8,325,560,759	100.00

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

その他の資産の投資状況

令和 3年 8月31日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
債券先物取引	売建	アメリカ	396,227,278	4.76
	売建	カナダ	217,061,890	2.61
	売建	ドイツ	434,373,310	5.22
	売建	オーストラリア	105,176,208	1.26

（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 8月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (％)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (％)
日本	国債証券	第 9 5 2 回国庫短期証券	400,000,000	100.09	400,371,400	100.02	400,107,600	—	2021/11/22	4.81
日本	国債証券	第 9 6 0 回国庫短期証券	340,000,000	100.10	340,362,440	100.03	340,115,600	—	2021/12/20	4.09
オーストラリア	社債券	3.85 GENERAL MOTO 230221	3,000,000	8,443.66	253,309,932	8,373.47	251,204,293	3.850000	2023/2/21	3.02
フランス	国債証券	1.75 O.A.T 230525	1,700,000	13,670.29	232,395,077	13,525.60	229,935,260	1.750000	2023/5/25	2.76
オーストラリア	社債券	3.45 AT&T INC 230919	2,500,000	8,591.71	214,792,859	8,466.12	211,653,050	3.450000	2023/9/19	2.54
日本	国債証券	第 9 6 6 回国庫短期証券	200,000,000	100.12	200,240,000	100.05	200,100,400	—	2022/1/20	2.40
日本	国債証券	第 1 0 0 7 回国庫短期証券	200,000,000	100.02	200,045,800	100.01	200,026,200	—	2021/10/11	2.40
ドイツ	特殊債券	0.2 LB BADEN-WUER 211213	1,500,000	13,028.65	195,429,860	12,992.55	194,888,275	0.200000	2021/12/13	2.34
スウェーデン	社債券	1.25 SWEDISH COVE 220615	15,000,000	1,296.58	194,487,878	1,288.05	193,208,903	1.250000	2022/6/15	2.32

カナダ	特殊債券	1.9 IBRD 250116	2,000,000	9,121.55	182,431,095	9,025.57	180,511,529	1.900000	2025/1/16	2.17
スウェーデン	社債券	1.5 STADSHYPOTEK 211215	14,000,000	1,290.60	180,684,619	1,280.15	179,222,014	1.500000	2021/12/15	2.15
アメリカ	社債券	STEP BRITISH TEL 301215	1,000,000	17,478.05	174,780,563	17,001.34	170,013,406	9.625000	2030/12/15	2.04
イギリス	社債券	1.875 VOLKSWAGEN 210907	1,100,000	15,235.73	167,593,061	15,128.84	166,417,300	1.875000	2021/9/7	2.00
オーストラリア	社債券	FRN NATIONAL A 230316	2,000,000	8,103.58	162,071,650	8,085.89	161,717,800	0.672100	2023/3/16	1.94
アイルランド	社債券	4.625 GE CAPITAL 270222	1,000,000	16,243.28	162,432,834	16,160.11	161,601,132	4.625000	2027/2/22	1.94
イギリス	社債券	2.125 BAT CAPITAL 250815	1,000,000	15,743.69	157,436,976	15,568.81	155,688,143	2.125000	2025/8/15	1.87
イギリス	社債券	2.519 BP CAPITAL 280407	1,000,000	14,934.42	149,344,260	14,931.18	149,311,837	2.519000	2028/4/7	1.79
オーストラリア	社債券	3 ING BANK (AUSTR 230907	1,700,000	8,534.99	145,094,983	8,430.61	143,320,402	3.000000	2023/9/7	1.72
アメリカ	特殊債券	1.75 ASIAN DEV 290919	1,200,000	11,349.63	136,195,677	11,460.54	137,526,587	1.750000	2029/9/19	1.65
ドイツ	特殊債券	1.5 KFW 240611	1,000,000	13,872.30	138,723,052	13,743.59	137,435,995	1.500000	2024/6/11	1.65
オーストラリア	社債券	1.125 VICINITY CE 291107	1,000,000	13,368.21	133,682,118	13,585.62	135,856,241	1.125000	2029/11/7	1.63
オーストラリア	特殊債券	4 KFW 250227	1,500,000	9,142.44	137,136,617	8,964.65	134,469,882	4.000000	2025/2/27	1.62
ドイツ	社債券	0.75 BAYER AG 270106	1,000,000	13,277.11	132,771,123	13,328.57	133,285,785	0.750000	2027/1/6	1.60
カナダ	特殊債券	1.5 ASIAN DEV 280504	1,500,000	8,694.25	130,413,874	8,808.45	132,126,764	1.500000	2028/5/4	1.59
イギリス	社債券	0.163 NATIONAL GR 280120	1,000,000	12,798.58	127,985,873	12,914.89	129,148,933	0.163000	2028/1/20	1.55
アメリカ	社債券	4.75 VIACOMCBS IN 250515	1,000,000	12,466.94	124,669,461	12,406.70	124,067,022	4.750000	2025/5/15	1.49
アメリカ	社債券	3.625 SCENTRE GRO 260128	1,000,000	12,042.65	120,426,541	12,014.63	120,146,329	3.625000	2026/1/28	1.44
アメリカ	社債券	2.512 SUMITOMO MI 250122	1,000,000	11,505.15	115,051,541	11,429.76	114,297,649	2.512000	2025/1/22	1.37
アメリカ	国債証券	0.125 T-NOTE 221130	1,000,000	10,993.00	109,930,049	10,992.14	109,921,464	0.125000	2022/11/30	1.32
日本	社債券	第34回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101.71	101,712,000	101.94	101,947,000	0.750000	2025/4/23	1.22

（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 8月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	17.78
地方債証券	1.11
特殊債券	12.22
社債券	38.90
合計	70.01

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

令和 3年 8月31日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（％）
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	NOTE10Y 2112	売建	27	アメリカドル	3,592,022.49	394,763,272	3,605,343.75	396,227,278	4.76
	カナダ	モントリオール取引所	CAN-B 2112	売建	17	カナダドル	2,490,602	217,055,964	2,490,670	217,061,890	2.61
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-B 2109	売建	19	ユーロ	3,258,857.2	422,641,189	3,349,320	434,373,310	5.22
	オーストラリア	シドニー先物取引所	AUST10Y 2109	売建	9	オーストラリアドル	1,274,564.7	102,194,597	1,311,751.17	105,176,208	1.26

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

三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド

投資状況

令和 3年 8月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	日本	8,150,273,300	60.56
社債券	日本	4,812,959,000	35.76
	スイス	100,312,000	0.75
	小計	4,913,271,000	36.51
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	—	394,855,070	2.93
純資産総額		13,458,399,370	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 8月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（％）	償還期限（年/月/日）	投資比率（％）
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	290,000,000	100.24	290,704,400	101.17	293,419,100	0.100000	2030/9/20	2.18
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	260,000,000	100.84	262,207,400	101.48	263,853,200	0.100000	2029/3/20	1.96

日本	国債証券	第１６６回利付国債（２０年）	220,000,000	105.01	231,035,200	106.57	234,465,000	0.700000	2038/9/20	1.74
日本	国債証券	第１５３回利付国債（２０年）	200,000,000	114.48	228,967,000	115.31	230,628,000	1.300000	2035/6/20	1.71
日本	国債証券	第６７回利付国債（３０年）	230,000,000	98.08	225,603,800	99.38	228,594,700	0.600000	2050/6/20	1.70
日本	社債券	第１４回ＳＢＩホールディングス	200,000,000	100.24	200,487,000	100.33	200,668,000	0.700000	2023/3/27	1.49
日本	社債券	第３回マラヤン・バンキング（２０１９）	200,000,000	100.02	200,042,000	100.01	200,032,000	0.270000	2022/5/20	1.49
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	100.00	200,000,000	99.95	199,914,000	0.270000	2025/6/24	1.49
日本	社債券	第６回マラヤン・バンキング	200,000,000	99.72	199,458,000	99.84	199,692,000	0.224000	2023/2/13	1.48
日本	国債証券	第３６３回利付国債（１０年）	190,000,000	100.80	191,532,900	100.78	191,485,800	0.100000	2031/6/20	1.42
日本	国債証券	第１６２回利付国債（２０年）	180,000,000	103.75	186,762,600	105.32	189,576,000	0.600000	2037/9/20	1.41
日本	国債証券	第１３０回利付国債（２０年）	150,000,000	117.75	176,632,500	117.73	176,607,000	1.800000	2031/9/20	1.31
日本	国債証券	第１５５回利付国債（２０年）	150,000,000	110.25	165,379,300	111.35	167,032,500	1.000000	2035/12/20	1.24
日本	国債証券	第１５２回利付国債（２０年）	140,000,000	113.00	158,205,600	113.79	159,306,000	1.200000	2035/3/20	1.18
日本	国債証券	第５８回利付国債（３０年）	150,000,000	104.10	156,151,800	106.03	159,055,500	0.800000	2048/3/20	1.18
日本	国債証券	第１２５回利付国債（２０年）	130,000,000	121.21	157,578,200	120.94	157,231,100	2.200000	2031/3/20	1.17
日本	国債証券	第１２８回利付国債（２０年）	130,000,000	118.47	154,015,700	118.38	153,903,100	1.900000	2031/6/20	1.14
日本	国債証券	第１６４回利付国債（２０年）	140,000,000	102.88	144,038,800	103.47	144,870,600	0.500000	2038/3/20	1.08
日本	国債証券	第１４６回利付国債（２０年）	120,000,000	118.64	142,376,800	118.98	142,778,400	1.700000	2033/9/20	1.06
日本	国債証券	第６０回利付国債（３０年）	130,000,000	106.58	138,559,700	108.24	140,713,300	0.900000	2048/9/20	1.05
日本	国債証券	第１５７回利付国債（２０年）	140,000,000	99.07	138,701,100	99.78	139,697,600	0.200000	2036/6/20	1.04
日本	国債証券	第１３６回利付国債（２０年）	120,000,000	115.99	139,190,400	116.32	139,588,800	1.600000	2032/3/20	1.04
日本	国債証券	第１５０回利付国債（２０年）	120,000,000	115.49	138,595,200	116.15	139,380,000	1.400000	2034/9/20	1.04
日本	国債証券	第１２３回利付国債（２０年）	110,000,000	119.84	131,824,000	119.64	131,608,400	2.100000	2030/12/20	0.98
日本	国債証券	第１４９回利付国債（２０年）	110,000,000	116.66	128,329,300	117.24	128,972,800	1.500000	2034/6/20	0.96
日本	国債証券	第１５９回利付国債（２０年）	120,000,000	104.14	124,971,600	105.46	126,562,800	0.600000	2036/12/20	0.94
日本	国債証券	第１５４回利付国債（２０年）	110,000,000	113.15	124,469,800	114.05	125,462,700	1.200000	2035/9/20	0.93
日本	国債証券	第１４３回利付国債（２０年）	100,000,000	117.00	117,006,000	117.32	117,325,000	1.600000	2033/3/20	0.87
日本	国債証券	第３６１回利付国債（１０年）	110,000,000	100.54	110,604,400	101.02	111,126,400	0.100000	2030/12/20	0.83
日本	国債証券	第１７２回利付国債（２０年）	110,000,000	98.90	108,795,100	100.69	110,764,500	0.400000	2040/3/20	0.82

（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 8月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	60.56
社債券	36.51
合計	97.07

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

フランス国債 7 - 10 年ラダーマザーファンド

投資状況

令和 3 年 8 月 31 日現在

（単位：円）

資産の種類	国 / 地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	フランス	24,351,008,021	96.98
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	757,180,059	3.02
純資産総額		25,108,188,080	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 8 月 31 日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
フランス	国債証券	0 0.A.T 291125	30,720,000	13,167.20	4,044,966,173	13,264.39	4,074,822,119	0.000000	2029/11/25	16.23
フランス	国債証券	0 0.A.T 301125	30,810,000	13,069.41	4,026,687,928	13,186.63	4,062,801,561	0.000000	2030/11/25	16.18
フランス	国債証券	0.5 0.A.T 290525	29,428,000	13,744.03	4,044,593,656	13,805.16	4,062,583,456	0.500000	2029/5/25	16.18
フランス	国債証券	1.5 0.A.T 310525	26,900,000	14,693.28	3,952,494,432	15,075.81	4,055,393,979	1.500000	2031/5/25	16.15
フランス	国債証券	2.5 0.A.T 300525	25,110,000	16,144.21	4,053,812,636	16,133.63	4,051,154,629	2.500000	2030/5/25	16.13
フランス	国債証券	0.75 0.A.T 281125	28,801,000	14,001.74	4,032,642,460	14,042.05	4,044,252,277	0.750000	2028/11/25	16.11

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 3年 8月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	96.98
合計	96.98

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ヘッジ付スペイン国債 7 - 10 年ラダーマザーファンド

投資状況

令和 3年 8月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国 / 地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	スペイン	11,437,971,410	97.17
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	332,562,919	2.83
純資産総額		11,770,534,329	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 8月31日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
スペイン	国債証券	0.1 SPAIN GOVT 310430	29,800,000	12,581.22	3,749,205,616	12,836.62	3,825,314,374	0.100000	2031/4/30	32.50
スペイン	国債証券	0.5 SPAIN GOVT 300430	28,380,000	13,328.24	3,782,554,881	13,449.70	3,817,027,401	0.500000	2030/4/30	32.43
スペイン	国債証券	1.45 SPAIN GOVT 290430	26,240,000	14,398.18	3,778,083,428	14,465.05	3,795,629,635	1.450000	2029/4/30	32.25

（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 8月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.17
合計	97.17

（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。

日本超長期国債インデックスマザーファンド

投資状況

令和 3年 8月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国 / 地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	日本	139,383,723,600	99.47
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	746,217,031	0.53
純資産総額		140,129,940,631	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 8月31日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第153回利付国債（20年）	3,170,000,000	114.69	3,635,673,000	115.31	3,655,453,800	1.300000	2035/6/20	2.61
日本	国債証券	第155回利付国債（20年）	3,010,000,000	110.64	3,330,444,600	111.35	3,351,785,500	1.000000	2035/12/20	2.39
日本	国債証券	第149回利付国債（20年）	2,770,000,000	116.82	3,236,024,800	117.24	3,247,769,600	1.500000	2034/6/20	2.32

日本	国債証券	第１５２回利付国債（２０年）	2,620,000,000	113.23	2,966,854,300	113.79	2,981,298,000	1.200000	2035/3/20	2.13
日本	国債証券	第１４６回利付国債（２０年）	2,500,000,000	118.64	2,966,054,000	118.98	2,974,550,000	1.700000	2033/9/20	2.12
日本	国債証券	第１４３回利付国債（２０年）	2,390,000,000	116.95	2,795,255,900	117.32	2,804,067,500	1.600000	2033/3/20	2.00
日本	国債証券	第１６４回利付国債（２０年）	2,480,000,000	102.64	2,545,704,600	103.47	2,566,279,200	0.500000	2038/3/20	1.83
日本	国債証券	第１５７回利付国債（２０年）	2,430,000,000	98.89	2,403,133,600	99.78	2,424,751,200	0.200000	2036/6/20	1.73
日本	国債証券	第１４８回利付国債（２０年）	2,070,000,000	116.65	2,414,737,800	116.98	2,421,610,200	1.500000	2034/3/20	1.73
日本	国債証券	第１６６回利付国債（２０年）	2,270,000,000	105.64	2,398,028,000	106.57	2,419,252,500	0.700000	2038/9/20	1.73
日本	国債証券	第１５０回利付国債（２０年）	1,990,000,000	115.68	2,302,131,500	116.15	2,311,385,000	1.400000	2034/9/20	1.65
日本	国債証券	第１６０回利付国債（２０年）	2,110,000,000	106.04	2,237,458,700	106.97	2,257,151,400	0.700000	2037/3/20	1.61
日本	国債証券	第５８回利付国債（３０年）	2,090,000,000	105.49	2,204,798,100	106.03	2,216,173,300	0.800000	2048/3/20	1.58
日本	国債証券	第１４７回利付国債（２０年）	1,870,000,000	117.64	2,199,998,900	118.01	2,206,824,400	1.600000	2033/12/20	1.57
日本	国債証券	第１７４回利付国債（２０年）	2,130,000,000	99.46	2,118,561,900	100.35	2,137,561,500	0.400000	2040/9/20	1.53
日本	国債証券	第３７回利付国債（３０年）	1,600,000,000	129.13	2,066,096,000	129.50	2,072,032,000	1.900000	2042/9/20	1.48
日本	国債証券	第３５回利付国債（３０年）	1,520,000,000	130.24	1,979,648,000	130.54	1,984,344,800	2.000000	2041/9/20	1.42
日本	国債証券	第１４２回利付国債（２０年）	1,610,000,000	119.05	1,916,800,200	119.33	1,921,229,100	1.800000	2032/12/20	1.37
日本	国債証券	第３６回利付国債（３０年）	1,430,000,000	130.66	1,868,566,700	131.00	1,873,314,300	2.000000	2042/3/20	1.34
日本	国債証券	第３０回利付国債（３０年）	1,380,000,000	133.09	1,836,766,200	133.67	1,844,701,200	2.300000	2039/3/20	1.32
日本	国債証券	第３２回利付国債（３０年）	1,320,000,000	134.13	1,770,516,000	134.78	1,779,162,000	2.300000	2040/3/20	1.27
日本	国債証券	第３４回利付国債（３０年）	1,280,000,000	133.47	1,708,454,400	133.84	1,713,241,600	2.200000	2041/3/20	1.22
日本	国債証券	第４６回利付国債（３０年）	1,380,000,000	122.14	1,685,566,800	122.61	1,692,114,600	1.500000	2045/3/20	1.21
日本	国債証券	第１６９回利付国債（２０年）	1,660,000,000	98.34	1,632,532,400	99.41	1,650,239,200	0.300000	2039/6/20	1.18
日本	国債証券	第１５１回利付国債（２０年）	1,410,000,000	113.17	1,595,697,000	113.69	1,603,071,300	1.200000	2034/12/20	1.14
日本	国債証券	第１４５回利付国債（２０年）	1,350,000,000	118.42	1,598,751,000	118.72	1,602,841,500	1.700000	2033/6/20	1.14
日本	国債証券	第５４回利付国債（３０年）	1,490,000,000	105.89	1,577,761,000	106.43	1,585,866,600	0.800000	2047/3/20	1.13
日本	国債証券	第１７１回利付国債（２０年）	1,560,000,000	98.09	1,530,328,800	99.05	1,545,242,400	0.300000	2039/12/20	1.10
日本	国債証券	第４９回利付国債（３０年）	1,280,000,000	120.11	1,537,446,400	120.67	1,544,678,400	1.400000	2045/12/20	1.10
日本	国債証券	第３３回利付国債（３０年）	1,180,000,000	129.17	1,524,260,000	129.81	1,531,852,400	2.000000	2040/9/20	1.09

（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 8月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	99.47

合計	99.47
----	-------

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

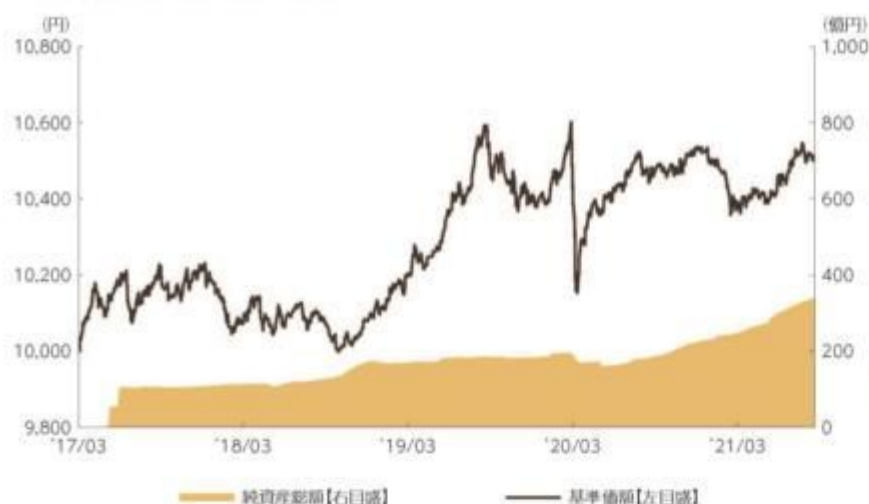
参考情報



運用実績

2021年8月31日現在

■基準価額・純資産の推移 2017年3月13日(設定日)～2021年8月31日



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

■基準価額・純資産

基準価額	10,514円
純資産総額	340.5億円

・純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

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

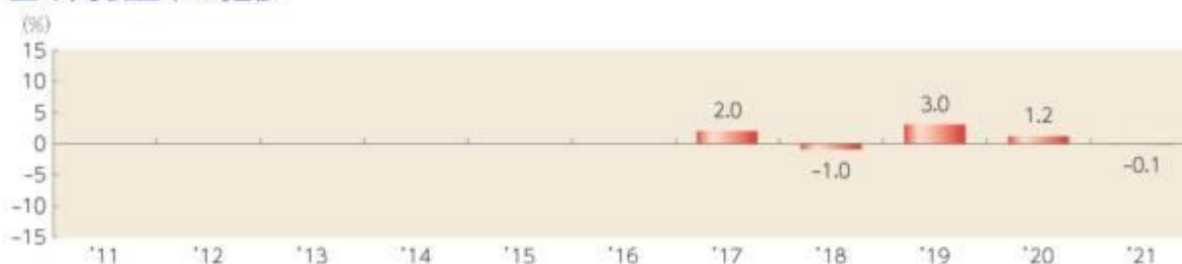
・分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

組入上位銘柄	比率
1 ショートデュレーション円インカムマザーファンド	22.1%
2 三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド	19.4%
3 日本超長期国債インデックスマザーファンド	14.6%
4 日本債券インデックスマザーファンド	14.6%
5 AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>(FOFs用)(適格機関投資家限定)	13.7%
6 MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド	7.0%
7 先進国高格付国債マザーファンド	1.9%
8 フランス国債7-10年ラダーマザーファンド	1.9%
9 ヘッジ付スペイン国債7-10年ラダーマザーファンド	1.9%

・比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

■年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額で計算
- ・2017年は設定日から年末までの、2021年は年初から8月31日までの収益率を表示
- ・ファンドにベンチマークはありません。

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

第３【ファンドの経理状況】

- １ 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）ならびに同規則第３８条の３および第５７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、中間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、当中間計算期間（令和３年２月６日から令和３年８月５日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【国内債券セレクション（ラップ向け）】

（１）【中間貸借対照表】

(単位：円)		
	第4期 [令和 3年 2月 5日現在]	第5期中間計算期間末 [令和 3年 8月 5日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	554,876,162	719,763,826
投資信託受益証券	2,529,870,506	4,546,304,224
親投資信託受益証券	21,102,853,256	27,798,996,209
流動資産合計	24,187,599,924	33,065,064,259
資産合計	24,187,599,924	33,065,064,259
負債の部		
流動負債		
未払解約金	31,993,100	9,490,998
未払受託者報酬	3,432,745	4,529,197
未払委託者報酬	36,615,821	48,311,339
未払利息	102	580
その他未払費用	411,863	543,437
流動負債合計	72,453,631	62,875,551
負債合計	72,453,631	62,875,551
純資産の部		
元本等		
元本	23,025,291,012	31,305,616,065
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,089,855,281	1,696,572,643
（分配準備積立金）	446,338,916	412,587,788
元本等合計	24,115,146,293	33,002,188,708
純資産合計	24,115,146,293	33,002,188,708
負債純資産合計	24,187,599,924	33,065,064,259

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)		
	第4期中間計算期間 自 令和 2年 2月 6日 至 令和 2年 8月 5日	第5期中間計算期間 自 令和 3年 2月 6日 至 令和 3年 8月 5日
営業収益		
受取利息	2,080	696

	第4期中間計算期間 自 令和 2年 2月 6日 至 令和 2年 8月 5日	第5期中間計算期間 自 令和 3年 2月 6日 至 令和 3年 8月 5日
有価証券売買等損益	110,831,236	303,466,671
営業収益合計	110,833,316	303,467,367
営業費用		
支払利息	82,140	60,619
受託者報酬	2,850,545	4,529,197
委託者報酬	30,405,796	48,311,339
その他費用	342,008	543,437
営業費用合計	33,680,489	53,444,592
営業利益又は営業損失（ ）	77,152,827	250,022,775
経常利益又は経常損失（ ）	77,152,827	250,022,775
中間純利益又は中間純損失（ ）	77,152,827	250,022,775
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	45,904,958	7,604,685
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	834,664,019	1,089,855,281
剰余金増加額又は欠損金減少額	137,524,786	443,780,884
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	137,524,786	443,780,884
剰余金減少額又は欠損金増加額	210,682,137	94,690,982
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	210,682,137	94,690,982
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	884,564,453	1,696,572,643

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

	第4期 [令和 3年 2月 5日現在]	第5期中間計算期間末 [令和 3年 8月 5日現在]
1. 期首元本額	18,454,023,512円	23,025,291,012円
期中追加設定元本額	11,312,543,909円	10,320,402,287円
期中一部解約元本額	6,741,276,409円	2,040,077,234円
2. 受益権の総数	23,025,291,012口	31,305,616,065口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

第4期中間計算期間 自 令和 2年 2月 6日 至 令和 2年 8月 5日	第5期中間計算期間 自 令和 3年 2月 6日 至 令和 3年 8月 5日
1. 運用に係る権限を委託するための費用	1. 運用に係る権限を委託するための費用

第4期中間計算期間 自 令和 2年 2月 6日 至 令和 2年 8月 5日	第5期中間計算期間 自 令和 3年 2月 6日 至 令和 3年 8月 5日
「先進国高格付国債マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の12.5以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	「先進国高格付国債マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の12.5以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	第4期 [令和 3年 2月 5日現在]	第5期中間計算期間末 [令和 3年 8月 5日現在]
1. 中間貸借対照表計上額、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）

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。

（１口当たり情報）

	第4期 [令和 3年 2月 5日現在]	第5期中間計算期間末 [令和 3年 8月 5日現在]
1口当たり純資産額	1.0473円	1.0542円
(1万口当たり純資産額)	(10,473円)	(10,542円)

（参考）

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

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 3年 8月 5日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,281,747,185
国債証券	274,425,511,600
地方債証券	17,616,925,118
特殊債券	19,370,640,938
社債券	16,347,208,000
派生商品評価勘定	6,522,300
未収利息	630,327,386
前払費用	19,027,992
差入委託証拠金	5,760,000
流動資産合計	330,703,670,519
資産合計	330,703,670,519
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,100
前受金	7,410,000
未払金	453,621,500
未払解約金	178,562,381
未払利息	1,839
流動負債合計	639,596,820
負債合計	639,596,820
純資産の部	
元本等	
元本	243,854,105,255
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	86,209,968,444
元本等合計	330,064,073,699
純資産合計	330,064,073,699
負債純資産合計	330,703,670,519

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 3年 8月 5日現在]
1. 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	240,296,636,471円
期中追加設定元本額	48,650,250,021円
期中一部解約元本額	45,092,781,237円
元本の内訳	
e M A X I S 国内債券インデックス	6,592,027,349円
e M A X I S バランス（8資産均等型）	3,157,310,206円
e M A X I S バランス（波乗り型）	155,703,679円
コアバランス	2,244,499円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３０（確定拠出年金）	1,961,800,214円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４０（確定拠出年金）	953,191,774円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５０（確定拠出年金）	400,844,848円
e M A X I S S l i m 国内債券インデックス	10,405,207,423円
国内債券セレクション（ラップ向け）	3,580,677,356円
e M A X I S S l i m バランス（8資産均等型）	9,120,015,723円
つみたて8資産均等バランス	4,118,315,518円
つみたて4資産均等バランス	1,241,935,784円
e M A X I S マイマネージャー １９７０s	5,988,125円
e M A X I S マイマネージャー １９８０s	879,476円
e M A X I S マイマネージャー １９９０s	119,903円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３５（確定拠出年金）	842,939,075円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４５（確定拠出年金）	340,309,874円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５５（確定拠出年金）	115,882,637円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金）	124,806,151円

	[令和 3年 8月 5日現在]
国内債券インデックスファンド（ラップ向け）	448,876,504円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６５（確定拠出年金）	21,114,630円
ラップ向けインデックスｆ 国内債券	3,389,717,286円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）	641,063,601円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）	632,721,190円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（積極型）	2,007,378円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	97,813,407円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	105,076,539円
eMAXIS 債券バランス（２資産均等型）	67,198,648円
eMAXIS バランス（４資産均等型）	719,348,094円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	1,149,845,539円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	610,270,454円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	1,241,927,833円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	164,173,349円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	21,586,305円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	65,150,984円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,138,721,447円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	1,053,300,512円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	4,970,052,588円
MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	132,255,148,347円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	534,546,291円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,825,418円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	2,239,382円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,870,471,905円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,243,601,731円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	4,009,455,934円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	331,502,540円
MUKAM 日本債券インデックスファンド２（適格機関投資家限定）	7,387,543,251円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション２（適格機関投資家限定）	3,080,898,817円
マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,711,031円
MUKAM アセットアロケーションファンド２０２０－０７（適格機関投資家限定）	464,386,656円
MUKAM アセットアロケーションファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	463,972,979円
MUKAM アセットアロケーションファンド２０２０－１１（適格機関投資家限定）	464,110,790円

	[令和 3年 8月 5日現在]
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01（適格機関投資家限定）	464,145,255円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03（適格機関投資家限定）	465,909,803円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05（適格機関投資家限定）	464,386,656円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07（適格機関投資家限定）	462,394,023円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	16,782,929円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	30,796,792円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	12,072,639円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	13,067,353円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	53,851,116円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	124,654,288円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	45,989,570円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	75,237,989円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	4,233,304,491円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	2,183,067,972円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	4,247,792,908円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	2,545,237,275円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	1,624,833,222円
合計	243,854,105,255円
2. 受益権の総数	243,854,105,255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）

金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 3年 8月 5日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。

区分	[令和 3年 8月 5日現在]
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

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

債券関連

[令和 3年 8月 5日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	1,212,510,000	—	1,219,040,000	6,530,000
合計		1,212,510,000	—	1,219,040,000	6,530,000

（注）時価の算定方法

1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（１口当たり情報）

	[令和 3年 8月 5日現在]
1口当たり純資産額	1.3535円
(1万口当たり純資産額)	(13,535円)

先進国高格付国債マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 3年 8月 5日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,183,276,202
国債証券	94,357,908,648

[令和 3年 8月 5日現在]

派生商品評価勘定	3,161,323,853
未収利息	458,131,893
前払費用	150,855,465
流動資産合計	99,311,496,061
資産合計	99,311,496,061
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,367,869
未払利息	954
流動負債合計	5,368,823
負債合計	5,368,823
純資産の部	
元本等	
元本	86,101,960,553
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	13,204,166,685
元本等合計	99,306,127,238
純資産合計	99,306,127,238
負債純資産合計	99,311,496,061

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 3年 8月 5日現在]
1. 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	83,694,364,368円
期中追加設定元本額	10,409,454,788円
期中一部解約元本額	8,001,858,603円
元本の内訳	
国内債券セレクション（ラップ向け）	560,891,412円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	17,020,106円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	18,569,426円
先進国高格付国債ファンド（ラップ向け）	111,627,823円
MUAM 先進国高格付国債ファンド（適格機関投資家転売制限付）	45,478,414,310円

	[令和 3年 8月 5日現在]
M U K A M 先進国高格付国債ファンド２０１６－０９（適格機関投資家転売制限付）	1,193,861,265円
M U K A M 先進国高格付国債ファンド２０１６－１０（適格機関投資家転売制限付）	850,777,033円
M U K A M 先進国高格付国債ファンド２０１６－１１（適格機関投資家転売制限付）	961,164,402円
M U K A M 先進国高格付国債ファンド２０１６－１２（適格機関投資家転売制限付）	1,892,584,417円
M U K A M 先進国高格付国債ファンド２０１７－０３（適格機関投資家転売制限付）	1,139,238,369円
M U K A M 先進国高格付国債ファンド２０１７－０５（適格機関投資家転売制限付）	5,441,143,825円
M U K A M 先進国高格付国債ファンド２０１７－０７（適格機関投資家転売制限付）	2,923,047,054円
M U K A M 先進国高格付国債ファンド２０１７－０９（適格機関投資家転売制限付）	2,616,491,062円
M U K A M 先進国高格付国債ファンド２０１７－１１（適格機関投資家転売制限付）	4,376,048,846円
M U K A M 先進国高格付国債ファンド２０１８－０１（適格機関投資家転売制限付）	4,632,297,460円
M U K A M 先進国高格付国債ファンド２０１８－０３（適格機関投資家転売制限付）	3,926,351,824円
M U K A M 先進国高格付国債ファンド２０１８－０６（適格機関投資家転売制限付）	2,285,546,150円
M U K A M 先進国高格付国債ファンド２０１８－０７（適格機関投資家転売制限付）	567,043,091円
M U K A M 先進国高格付国債ファンド２０１８－０９（適格機関投資家転売制限付）	4,130,285,523円
M U K A M 先進国高格付国債ファンド２０１８－１０（適格機関投資家転売制限付）	1,152,818,724円
M U K A M 先進国高格付国債ファンド２０１８－１１（適格機関投資家転売制限付）	440,594,947円
M U K A M 先進国高格付国債ファンド２０１８－１２（適格機関投資家転売制限付）	349,602,883円
M U K A M 先進国高格付国債ファンド２０１９－０３（適格機関投資家転売制限付）	1,036,540,601円
合計	86,101,960,553円
２． 受益権の総数	86,101,960,553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）

金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 3年 8月 5日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

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

通貨関連

[令和 3年 8月 5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				
	カナダドル	411,235,039	—	410,927,998	307,041
	オーストラリアドル	668,540,762	—	663,479,934	5,060,828
	売建				
	カナダドル	19,652,644,568	—	18,991,830,119	660,814,449
	オーストラリアドル	39,261,199,846	—	37,508,025,410	1,753,174,436
	シンガポールドル	38,431,206,512	—	37,683,871,544	747,334,968
合計		98,424,826,727	—	95,258,135,005	3,155,955,984

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（１口当たり情報）

	[令和 3年 8月 5日現在]
1口当たり純資産額	1.1534円
(1万口当たり純資産額)	(11,534円)

MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 3年 8月 5日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	2,806,827,954
コール・ローン	1,526,812,136
国債証券	156,908,483,379
未収入金	18,867,323,812
未収利息	405,525,899
前払費用	70,611,019
流動資産合計	180,585,584,199
資産合計	180,585,584,199
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	360,189,383
未払金	19,828,405,747
未払解約金	11,481,855
未払利息	1,231
流動負債合計	20,200,078,216
負債合計	20,200,078,216
純資産の部	
元本等	
元本	89,717,545,181
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	70,667,960,802
元本等合計	160,385,505,983
純資産合計	160,385,505,983
負債純資産合計	180,585,584,199

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
-------------------	---

2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 3年 8月 5日現在]
1. 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	99,382,959,964円
期中追加設定元本額	7,136,302,565円
期中一部解約元本額	16,801,717,348円
元本の内訳	
国内債券セレクション（ラップ向け）	1,315,634,332円
三菱ＵＦＪ ヘッジ付外国債券オープン	55,391,673,425円
MUAM ヘッジ付外国債券オープン（適格機関投資家限定）	5,988,017,783円
三菱ＵＦＪ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	22,989,024,402円
三菱ＵＦＪ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	802,347,527円
三菱ＵＦＪ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	1,900,491,884円
三菱ＵＦＪ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	831,385,558円
三菱ＵＦＪ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	5,250,175円
三菱ＵＦＪ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	412,863,213円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	37,542,336円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	43,314,546円
合計	89,717,545,181円
2. 受益権の総数	89,717,545,181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）

金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 3年 8月 5日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引

区分	[令和 3年 8月 5日現在]
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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）

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

通貨関連

[令和 3年 8月 5日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカドル	72,915,468,607	—	73,216,547,816	301,079,209
	カナダドル	3,278,253,760	—	3,286,537,040	8,283,280
	オーストラリアドル	3,147,838,144	—	3,160,245,056	12,406,912
	イギリスポンド	10,356,774,300	—	10,387,116,864	30,342,564
	スウェーデンクローネ	475,657,509	—	475,847,400	189,891
	ポーランドズロチ	1,016,434,485	—	1,017,950,460	1,515,975
	ユーロ	65,811,565,750	—	65,817,937,302	6,371,552
合計		157,001,992,555	—	157,362,181,938	360,189,383

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（１口当たり情報）

	[令和 3年 8月 5日現在]
1口当たり純資産額	1.7877円
(1万口当たり純資産額)	(17,877円)

ショートデュレーション円インカムマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[令和 3年 8月 5日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	136,507,458
コール・ローン	2,430,457,457
国債証券	1,480,630,405
地方債証券	92,790,541
特殊債券	1,022,916,835
社債券	3,258,220,521
派生商品評価勘定	3,672,108
未収利息	35,667,708
前払費用	1,291,711
差入委託証拠金	176,390,789
流動資産合計	8,638,545,533
資産合計	8,638,545,533
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	36,212,922
未払解約金	25,111
未払利息	1,959
流動負債合計	36,239,992
負債合計	36,239,992
純資産の部	
元本等	
元本	8,878,709,987
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	276,404,446
元本等合計	8,602,305,541
純資産合計	8,602,305,541
負債純資産合計	8,638,545,533

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。 為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。
---------------------------	--

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 3年 8月 5日現在]
1. 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	7,275,464,134円
期中追加設定元本額	2,712,210,646円
期中一部解約元本額	1,108,964,793円
元本の内訳	
国内債券セクション（ラップ向け）	7,582,229,490円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	212,980,561円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	243,090,633円
ショートデュレーション円インカムオープン（ラップ向け）	840,409,303円
合計	8,878,709,987円
2. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	276,404,446円
3. 受益権の総数	8,878,709,987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）

金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 3年 8月 5日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

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

債券関連

[令和 3年 8月 5日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	売建	1,129,695,606	—	1,162,905,806	33,210,200
合計		1,129,695,606	—	1,162,905,806	33,210,200

（注）時価の算定方法

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

通貨関連

[令和 3年 8月 5日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカドル	903,149,260	—	899,688,745	3,460,515
	カナダドル	741,924,120	—	741,744,132	179,988
	オーストラリアドル	1,177,850,456	—	1,179,183,611	1,333,155
	イギリスポンド	332,206,575	—	333,289,092	1,082,517
	スウェーデンクローネ	383,204,605	—	383,173,000	31,605
	ユーロ	1,291,529,900	—	1,292,116,950	587,050
合計		4,829,864,916	—	4,829,195,530	669,386

（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。

（１口当たり情報）

	[令和 3年 8月 5日現在]
1口当たり純資産額	0.9689円
(1万口当たり純資産額)	(9,689円)

三菱ＵＦＪ 国内債券アクティブマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 3年 8月 5日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	495,352,241
国債証券	8,043,937,700
社債券	4,813,855,000
未収利息	26,197,962
前払費用	845,382
流動資産合計	13,380,188,285
資産合計	13,380,188,285
負債の部	
流動負債	
未払解約金	16,041,361
未払利息	399
流動負債合計	16,041,760
負債合計	16,041,760
純資産の部	
元本等	
元本	9,046,856,240
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,317,290,285
元本等合計	13,364,146,525
純資産合計	13,364,146,525
負債純資産合計	13,380,188,285

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
-------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 3年 8月 5日現在]
1. 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	8,152,581,997円
期中追加設定元本額	1,641,063,698円
期中一部解約元本額	746,789,455円
元本の内訳	
国内債券通貨プラス	785,648,630円
国内債券セレクション（ラップ向け）	4,374,784,859円
三菱ＵＦＪ アドバンス・バランス（安定型）	126,221,028円
三菱ＵＦＪ アドバンス・バランス（安定成長型）	140,938,640円
三菱ＵＦＪ 日本バランスオープン 株式２０型	633,520,423円
三菱ＵＦＪ 日本バランスオープン 株式４０型	607,721,638円
三菱ＵＦＪ ライフプラン ２５	451,188,768円
三菱ＵＦＪ ライフプラン ５０	553,205,721円
三菱ＵＦＪ ライフプラン ７５	169,008,329円
三菱ＵＦＪ ライフプラン ５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	216,124,178円
三菱ＵＦＪ 世界バランスファンド ２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	25,300,838円
三菱ＵＦＪ 世界バランスファンド ５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	90,188,455円
三菱ＵＦＪ ライフ・バランスファンド（安定型）	102,516,375円
三菱ＵＦＪ ライフ・バランスファンド（安定成長型）	48,920,298円
三菱ＵＦＪ ライフ・バランスファンド（成長型）	23,149,775円
三菱ＵＦＪ ライフ・バランスファンド（積極型）	38,439,810円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤーファンド ２０３０	14,859,913円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤーファンド ２０４０	10,176,962円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>ライフ・バランスファンド（安定型）	92,425,925円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>ライフ・バランスファンド（安定成長型）	139,469,489円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>ライフ・バランスファンド（成長型）	66,260,502円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>ライフ・バランスファンド（積極型）	58,094,549円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>ターゲット・イヤー ファンド ２０３０	161,847,505円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>ターゲット・イヤー ファンド ２０４０	116,843,630円
合計	9,046,856,240円
2. 受益権の総数	9,046,856,240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）

金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 3年 8月 5日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はあります。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券

区分	[令和 3年 8月 5日現在]
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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。 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。

（１口当たり情報）

	[令和 3年 8月 5日現在]
1口当たり純資産額	1.4772円
(1万口当たり純資産額)	(14,772円)

フランス国債７－１０年ラダーマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 3年 8月 5日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	80,800,943
コール・ローン	339,980,324
国債証券	24,181,264,480
派生商品評価勘定	46,151,370
未収入金	203,395
未収利息	45,818,753
前払費用	3,135,802
流動資産合計	24,697,355,067
資産合計	24,697,355,067

[令和 3年 8月 5日現在]

負債の部	
流動負債	
未払解約金	524,186
未払利息	274
流動負債合計	524,460
負債合計	524,460
純資産の部	
元本等	
元本	21,433,010,037
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,263,820,570
元本等合計	24,696,830,607
純資産合計	24,696,830,607
負債純資産合計	24,697,355,067

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 3年 8月 5日現在]
1. 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	18,675,694,876円
期中追加設定元本額	3,690,122,145円
期中一部解約元本額	932,806,984円
元本の内訳	
国内債券セレクション（ラップ向け）	562,013,366円
フランス国債7 - 10年ラダーファンド（為替ヘッジあり）（ラップ向け）	5,120,351円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	18,260,222円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	19,455,963円
MUKAM フランス国債7 - 10年ラダーオープン（為替ヘッジあり）（適格機関投資家転売制限付）	6,134,572,846円
MUKAM フランス国債7 - 10年ラダーファンド（為替ヘッジあり）2017 - 06（適格機関投資家限定）	559,254,445円
MUKAM フランス国債7 - 10年ラダーファンド（為替ヘッジあり）2018 - 06（適格機関投資家限定）	1,948,329,836円

	[令和 3年 8月 5日現在]
MUKAM フランス国債7 - 10年ラダーファンド（為替ヘッジあり）2018 - 07（適格機関投資家限定）	3,704,715,996円
MUKAM フランス国債7 - 10年ラダーファンド（為替ヘッジあり）2018 - 10（適格機関投資家限定）	467,366,045円
MUKAM フランス国債7 - 10年ラダーファンド（為替ヘッジあり）2018 - 11（適格機関投資家限定）	2,780,014,117円
MUKAM フランス国債7 - 10年ラダーファンド（為替ヘッジあり）2019 - 01（適格機関投資家限定）	3,884,398,849円
MUKAM フランス国債7 - 10年ラダーファンド（為替ヘッジあり）2019 - 05（適格機関投資家限定）	1,349,508,001円
合計	21,433,010,037円
2. 受益権の総数	21,433,010,037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）

金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 3年 8月 5日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

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

通貨関連

[令和 3年 8月 5日現在]

--	--	--	--	--

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	ユーロ	23,855,283,000	—	23,809,131,630	46,151,370
合計		23,855,283,000	—	23,809,131,630	46,151,370

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（１口当たり情報）

	[令和 3年 8月 5日現在]
1口当たり純資産額	1.1523円
(1万口当たり純資産額)	(11,523円)

ヘッジ付スペイン国債 7 - 10 年ラダーマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 3年 8月 5日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	63,032,504
コール・ローン	140,253,212
国債証券	11,477,128,629
派生商品評価勘定	86,149,926
未収入金	3,561,659
未収利息	19,038,381
流動資産合計	11,789,164,311
資産合計	11,789,164,311
負債の部	
流動負債	
未払解約金	312,254
未払利息	113
流動負債合計	312,367
負債合計	312,367
純資産の部	
元本等	
元本	10,695,692,615
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,093,159,329

[令和 3年 8月 5日現在]

元本等合計	11,788,851,944
純資産合計	11,788,851,944
負債純資産合計	11,789,164,311

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 3年 8月 5日現在]
1. 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	12,744,353,076円
期中追加設定元本額	220,638,037円
期中一部解約元本額	2,269,298,498円
元本の内訳	
国内債券セレクション（ラップ向け）	587,370,505円
スペイン国債7 - 10年ラダーファンド（為替ヘッジあり）（ラップ向け）	436,561,846円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	12,103,747円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	19,778,038円
MUKAM スペイン国債7 - 10年ラダーオープン（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	2,782,343,156円
MUKAM スペイン国債7 - 10年ラダーオープン（為替ヘッジあり）（適格機関投資家転売制限付）	1,858,574,818円
MUKAM スペイン国債7 - 10年ラダーファンド（為替ヘッジあり）2019 - 04（適格機関投資家限定）	3,960,837,959円
MUKAM スペイン国債7 - 10年ラダーファンド（為替ヘッジあり）2019 - 06（適格機関投資家限定）	286,374,011円
MUKAM スペイン国債7 - 10年ラダーファンド（為替ヘッジあり）2019 - 07（適格機関投資家限定）	751,748,535円
合計	10,695,692,615円
2. 受益権の総数	10,695,692,615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）

金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 3年 8月 5日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

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

通貨関連

[令和 3年 8月 5日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 ユーロ	11,498,180,148	—	11,412,030,222	86,149,926
合計		11,498,180,148	—	11,412,030,222	86,149,926

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（１口当たり情報）

	[令和 3年 8月 5日現在]
1口当たり純資産額	1.1022円
(1万口当たり純資産額)	(11,022円)

日本超長期国債インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 3年 8月 5日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	288,441,313
国債証券	139,771,679,500
未収利息	407,318,007
前払費用	12,166,958
流動資産合計	140,479,605,778
資産合計	140,479,605,778
負債の部	
流動負債	
未払金	30,553,800
未払解約金	1,136,833
未払利息	232
流動負債合計	31,690,865
負債合計	31,690,865
純資産の部	
元本等	
元本	137,240,633,530
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,207,281,383
元本等合計	140,447,914,913
純資産合計	140,447,914,913
負債純資産合計	140,479,605,778

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
--------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 3年 8月 5日現在]
1. 期首	令和 3年 2月 6日

	[令和 3年 8月 5日現在]
期首元本額	126,424,297,808円
期中追加設定元本額	13,812,773,647円
期中一部解約元本額	2,996,437,925円
元本の内訳	
国内債券セレクション（ラップ向け）	4,738,905,260円
MUKAM 日本超長期国債インデックスファンド（適格機関投資家限定）	128,256,776,804円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	2,204,771,998円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2（適格機関投資家限定）	1,741,002,657円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	142,784,655円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	156,392,156円
合計	137,240,633,530円
2. 受益権の総数	137,240,633,530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）

金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 3年 8月 5日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

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。

（１口当たり情報）

	[令和 3年 8月 5日現在]
1口当たり純資産額	1.0234円
(1万口当たり純資産額)	(10,234円)

２【ファンドの現況】

【国内債券セレクション（ラップ向け）】

【純資産額計算書】

令和 3年 8月31日現在

（単位：円）

資産総額	34,115,762,029
負債総額	62,423,412
純資産総額（ - ）	34,053,338,617
発行済口数	32,388,260,911口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.0514
（10,000口当たり）	（10,514）

（参考）

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 3年 8月31日現在

（単位：円）

資産総額	336,595,805,347
負債総額	6,297,405,103
純資産総額（ - ）	330,298,400,244
発行済口数	244,389,379,175口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.3515
（10,000口当たり）	（13,515）

先進国高格付国債マザーファンド

純資産額計算書

令和 3年 8月31日現在

（単位：円）

資産総額	99,752,597,625
負債総額	28,877,877
純資産総額（ - ）	99,723,719,748
発行済口数	86,690,361,134口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.1503
（10,000口当たり）	（11,503）

MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド

純資産額計算書

令和 3年 8月31日現在

（単位：円）

資産総額	158,028,590,292
負債総額	477,061,272
純資産総額（ - ）	157,551,529,020
発行済口数	88,503,321,962口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.7802
（10,000口当たり）	（17,802）

ショートデュレーション円インカムマザーファンド

純資産額計算書

令和 3年 8月31日現在

（単位：円）

資産総額	8,345,026,445
負債総額	19,465,686
純資産総額（ - ）	8,325,560,759
発行済口数	8,593,594,899口
1口当たり純資産価額（ / ）	0.9688
（10,000口当たり）	（9,688）

三菱ＵＦＪ 国内債券アクティブマザーファンド

純資産額計算書

令和 3年 8月31日現在

（単位：円）

資産総額	13,639,608,392
負債総額	181,209,022
純資産総額（ - ）	13,458,399,370
発行済口数	9,123,178,045口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.4752
（10,000口当たり）	（14,752）

フランス国債 7 - 10 年ラダーマザーファンド

純資産額計算書

令和 3年 8月31日現在

（単位：円）

資産総額	25,109,439,617
負債総額	1,251,537
純資産総額（ - ）	25,108,188,080
発行済口数	21,877,935,689口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.1476
（10,000口当たり）	（11,476）

ヘッジ付スペイン国債 7 - 10 年ラダーマザーファンド

純資産額計算書

令和 3年 8月31日現在

（単位：円）

資産総額	11,775,098,333
負債総額	4,564,004
純資産総額（ - ）	11,770,534,329
発行済口数	10,703,367,441口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.0997
（10,000口当たり）	（10,997）

日本超長期国債インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 3年 8月31日現在

（単位：円）

資産総額	141,620,317,358
負債総額	1,490,376,727
純資産総額（ - ）	140,129,940,631
発行済口数	137,325,158,902口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.0204
（10,000口当たり）	（10,204）

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

< 更新後 >

（１）資本金の額等

2021年8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。

ファンドに関係する法人等の管理

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

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】

< 更新後 >

「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 8月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本 数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	887	17,959,631
追加型公社債投資信託	16	1,409,049
単位型株式投資信託	82	368,482
単位型公社債投資信託	45	181,908
合 計	1,030	19,919,070

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】

< 更新後 >

(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			利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	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			利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	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		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,815	1,815	79,922,854
当期変動額			
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	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	9,859,345	8,694,010	1,165,334
	小計	9,859,345	8,694,010	1,165,334
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	8,874,369	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	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	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	(株)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(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,234,629 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	(株)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(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,128,270 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、記載していません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第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

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】

<更新後>

（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
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。

3【資本関係】

<訂正前>

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2021年2月末現在）

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

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

<訂正後>

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8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。

独立監査人の中間監査報告書

令和３年９月８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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている国内債券セクション（ラップ向け）の令和３年２月６日から令和３年８月５日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、国内債券セクション（ラップ向け）の令和３年８月５日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（令和３年２月６日から令和３年８月５日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付

ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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。

- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

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。