

**【表紙】**

|            |                                |
|------------|--------------------------------|
| 【提出書類】     | 半期報告書                          |
| 【提出先】      | 関東財務局長殿                        |
| 【提出日】      | 2021年12月24日提出                  |
| 【計算期間】     | 第8期中(自 2021年3月26日至 2021年9月25日) |
| 【ファンド名】    | 三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）      |
| 【発行者名】     | 三菱ＵＦＪ国際投信株式会社                  |
| 【代表者の役職氏名】 | 取締役社長 横川 直                     |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都千代田区有楽町一丁目 1 2 番 1 号        |
| 【事務連絡者氏名】  | 伊藤 晃                           |
| 【連絡場所】     | 東京都千代田区有楽町一丁目 1 2 番 1 号        |
| 【電話番号】     | 03-6250-4740                   |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。                    |

# 1【ファンドの運用状況】

## 【三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）】

### （１）【投資状況】

令和 3年 9月30日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域 | 時価合計           | 投資比率（％） |
|--------------------------|------|----------------|---------|
| 親投資信託受益証券                | 日本   | 13,600,408,480 | 97.89   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | 292,926,689    | 2.11    |
| 純資産総額                    |      | 13,893,335,169 | 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）【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9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<br>（1万口当たりの純資産価額） |        |
|-----------------------|----------------|----------------|------------------------|--------|
|                       | （分配落）          | （分配付）          | （分配落）                  | （分配付）  |
| 第1計算期間末日（平成27年 3月25日） | 742,687,448    | 742,687,448    | 10,134                 | 10,134 |
| 第2計算期間末日（平成28年 3月25日） | 11,025,075,827 | 11,025,075,827 | 10,173                 | 10,173 |
| 第3計算期間末日（平成29年 3月27日） | 16,616,034,403 | 16,616,034,403 | 10,023                 | 10,023 |
| 第4計算期間末日（平成30年 3月26日） | 21,932,224,268 | 21,932,224,268 | 10,176                 | 10,176 |
| 第5計算期間末日（平成31年 3月25日） | 20,047,910,451 | 20,047,910,451 | 10,283                 | 10,283 |
| 第6計算期間末日（令和 2年 3月25日） | 16,454,342,720 | 16,454,342,720 | 10,148                 | 10,148 |
| 第7計算期間末日（令和 3年 3月25日） | 14,422,734,839 | 14,422,734,839 | 10,432                 | 10,432 |
| 令和 2年 9月末日            | 15,304,867,239 | —              | 10,188                 | —      |
| 10月末日                 | 15,081,396,546 | —              | 10,105                 | —      |
| 11月末日                 | 15,092,891,039 | —              | 10,301                 | —      |
| 12月末日                 | 15,205,238,165 | —              | 10,355                 | —      |
| 令和 3年 1月末日            | 15,194,915,135 | —              | 10,347                 | —      |
| 2月末日                  | 14,591,890,959 | —              | 10,290                 | —      |
| 3月末日                  | 14,451,563,470 | —              | 10,451                 | —      |
| 4月末日                  | 14,422,919,588 | —              | 10,469                 | —      |
| 5月末日                  | 14,283,206,729 | —              | 10,500                 | —      |
| 6月末日                  | 14,090,744,781 | —              | 10,546                 | —      |
| 7月末日                  | 13,963,795,807 | —              | 10,599                 | —      |

|      |                |   |        |   |
|------|----------------|---|--------|---|
| 8月末日 | 13,793,697,167 | — | 10,650 | — |
| 9月末日 | 13,893,335,169 | — | 10,604 | — |

## 【分配の推移】

|        | 1万口当たりの分配金 |
|--------|------------|
| 第1計算期間 | 0円         |
| 第2計算期間 | 0円         |
| 第3計算期間 | 0円         |
| 第4計算期間 | 0円         |
| 第5計算期間 | 0円         |
| 第6計算期間 | 0円         |
| 第7計算期間 | 0円         |

## 【収益率の推移】

|          | 収益率（％） |
|----------|--------|
| 第1計算期間   | 1.34   |
| 第2計算期間   | 0.38   |
| 第3計算期間   | 1.47   |
| 第4計算期間   | 1.52   |
| 第5計算期間   | 1.05   |
| 第6計算期間   | 1.31   |
| 第7計算期間   | 2.79   |
| 第8中間計算期間 | 2.26   |

（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。

（参考）

ＴＯＰＩＸマザーファンド

投資状況

令和 3年 9月30日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域 | 時価合計            | 投資比率（％） |
|--------------------------|------|-----------------|---------|
| 株式                       | 日本   | 776,983,180,670 | 97.34   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | 21,257,386,200  | 2.66    |
| 純資産総額                    |      | 798,240,566,870 | 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 9月30日現在

（単位：円）

| 資産の種類    | 建別 | 国 / 地域 | 時価合計           | 投資比率（％） |
|----------|----|--------|----------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | 日本     | 13,056,115,000 | 1.64    |

（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。

## 外国株式インデックスマザーファンド

### 投資状況

令和 3年 9月30日現在

（単位：円）

| 資産の種類 | 国 / 地域   | 時価合計              | 投資比率（％） |
|-------|----------|-------------------|---------|
| 株式    | アメリカ     | 781,188,377,169   | 69.04   |
|       | イギリス     | 47,115,251,230    | 4.16    |
|       | カナダ      | 37,649,841,985    | 3.33    |
|       | フランス     | 34,882,629,302    | 3.08    |
|       | スイス      | 32,402,545,675    | 2.86    |
|       | ドイツ      | 30,785,195,158    | 2.72    |
|       | オーストラリア  | 21,456,970,064    | 1.90    |
|       | オランダ     | 21,045,229,442    | 1.86    |
|       | スウェーデン   | 12,436,654,310    | 1.10    |
|       | 香港       | 9,236,351,140     | 0.82    |
|       | デンマーク    | 8,948,253,467     | 0.79    |
|       | スペイン     | 8,296,780,437     | 0.73    |
|       | イタリア     | 6,237,138,924     | 0.55    |
|       | フィンランド   | 3,457,726,805     | 0.31    |
|       | シンガポール   | 3,047,323,447     | 0.27    |
|       | ベルギー     | 2,789,959,457     | 0.25    |
|       | アイルランド   | 2,435,102,743     | 0.22    |
|       | ノルウェー    | 2,199,716,710     | 0.19    |
|       | イスラエル    | 1,280,587,154     | 0.11    |
|       | ルクセンブルグ  | 1,048,498,173     | 0.09    |
|       | ニュージーランド | 778,731,871       | 0.07    |
|       | オーストリア   | 747,066,583       | 0.07    |
|       | ポルトガル    | 514,614,843       | 0.05    |
|       | 小計       | 1,069,980,546,089 | 94.56   |

|                          |         |                   |        |
|--------------------------|---------|-------------------|--------|
| 投資証券                     | アメリカ    | 20,906,564,376    | 1.85   |
|                          | オーストラリア | 1,466,137,572     | 0.13   |
|                          | イギリス    | 634,778,040       | 0.06   |
|                          | シンガポール  | 433,681,021       | 0.04   |
|                          | 香港      | 341,633,209       | 0.03   |
|                          | フランス    | 326,892,056       | 0.03   |
|                          | オランダ    | 193,654,830       | 0.02   |
|                          | カナダ     | 136,461,657       | 0.01   |
| 小計                       |         | 24,439,802,761    | 2.16   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —       | 37,148,937,821    | 3.28   |
| 純資産総額                    |         | 1,131,569,286,671 | 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 9月30日現在

（単位：円）

| 資産の種類    | 建別 | 国／地域    | 時価合計           | 投資比率（％） |
|----------|----|---------|----------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ    | 26,629,273,894 | 2.35    |
|          | 買建 | カナダ     | 1,308,899,372  | 0.12    |
|          | 買建 | ドイツ     | 4,706,380,925  | 0.42    |
|          | 買建 | オーストラリア | 1,299,107,160  | 0.11    |
|          | 買建 | イギリス    | 2,713,945,237  | 0.24    |
|          | 買建 | スイス     | 1,004,517,676  | 0.09    |

（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。

#### 国内債券インデックスマザーファンド

##### 投資状況

令和 3年 9月30日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域 | 時価合計            | 投資比率（％） |
|--------------------------|------|-----------------|---------|
| 国債証券                     | 日本   | 165,471,378,840 | 83.29   |
| 地方債証券                    | 日本   | 10,649,627,640  | 5.36    |
| 特殊債券                     | 日本   | 9,865,896,814   | 4.97    |
| 社債券                      | 日本   | 11,170,376,100  | 5.62    |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | 1,522,751,310   | 0.76    |
| 純資産総額                    |      | 198,680,030,704 | 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 9月30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   | 756,850,000 | 0.38    |

（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。

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

### 投資状況

令和 3年 9月30日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域    | 時価合計            | 投資比率（％） |
|--------------------------|---------|-----------------|---------|
| 国債証券                     | アメリカ    | 130,224,081,322 | 46.30   |
|                          | フランス    | 28,041,410,503  | 9.97    |
|                          | イタリア    | 26,805,473,190  | 9.53    |
|                          | ドイツ     | 20,178,869,169  | 7.17    |
|                          | イギリス    | 16,859,620,052  | 5.99    |
|                          | スペイン    | 16,703,002,107  | 5.94    |
|                          | ベルギー    | 6,628,635,225   | 2.36    |
|                          | カナダ     | 5,469,065,857   | 1.94    |
|                          | オランダ    | 5,352,645,288   | 1.90    |
|                          | オーストラリア | 5,110,414,843   | 1.82    |
|                          | オーストリア  | 4,120,905,870   | 1.47    |
|                          | アイルランド  | 2,344,009,039   | 0.83    |
|                          | メキシコ    | 1,980,125,004   | 0.70    |
|                          | フィンランド  | 1,616,039,080   | 0.57    |
|                          | ポーランド   | 1,561,520,036   | 0.56    |
|                          | マレーシア   | 1,395,193,641   | 0.50    |
|                          | イスラエル   | 1,306,820,572   | 0.46    |
|                          | デンマーク   | 1,306,357,648   | 0.46    |
|                          | シンガポール  | 1,236,461,775   | 0.44    |
|                          | スウェーデン  | 792,524,921     | 0.28    |
|                          | ノルウェー   | 703,715,812     | 0.25    |
|                          | 小計      | 279,736,890,954 | 99.45   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —       | 1,537,607,876   | 0.55    |
| 純資産総額                    |         | 281,274,498,830 | 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【設定及び解約の実績】

## 【三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）】

|          | 設定口数           | 解約口数           | 発行済口数          |
|----------|----------------|----------------|----------------|
| 第1計算期間   | 732,873,947    | —              | 732,873,947    |
| 第2計算期間   | 11,486,296,630 | 1,381,419,783  | 10,837,750,794 |
| 第3計算期間   | 21,473,572,188 | 15,733,760,914 | 16,577,562,068 |
| 第4計算期間   | 32,380,246,241 | 27,404,473,314 | 21,553,334,995 |
| 第5計算期間   | 8,985,153,584  | 11,043,106,470 | 19,495,382,109 |
| 第6計算期間   | 2,884,756,264  | 6,166,027,869  | 16,214,110,504 |
| 第7計算期間   | 1,565,612,291  | 3,953,735,938  | 13,825,986,857 |
| 第8中間計算期間 | 689,085,874    | 1,403,268,834  | 13,111,803,897 |

### 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3月26日から令和3年9月25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。

## 【三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第7期<br>[ 令和 3年 3月25日現在 ] | 第8期中間計算期間末<br>[ 令和 3年 9月25日現在 ] |
|-----------------|--------------------------|---------------------------------|
| 資産の部            |                          |                                 |
| 流動資産            |                          |                                 |
| 金銭信託            | -                        | 300,001                         |
| コール・ローン         | 319,471,500              | 378,782,410                     |
| 親投資信託受益証券       | 14,127,345,112           | 13,681,635,356                  |
| 未収入金            | 92,000,000               | 33,000,000                      |
| 流動資産合計          | 14,538,816,612           | 14,093,717,767                  |
| 資産合計            | 14,538,816,612           | 14,093,717,767                  |
| 負債の部            |                          |                                 |
| 流動負債            |                          |                                 |
| 未払解約金           | 29,424,848               | 23,658,584                      |
| 未払受託者報酬         | 3,289,938                | 3,142,845                       |
| 未払委託者報酬         | 83,070,895               | 79,356,880                      |
| 未払利息            | 55                       | 96                              |
| その他未払費用         | 296,037                  | 282,791                         |
| 流動負債合計          | 116,081,773              | 106,441,196                     |
| 負債合計            | 116,081,773              | 106,441,196                     |
| 純資産の部           |                          |                                 |
| 元本等             |                          |                                 |
| 元本              | 13,825,986,857           | 13,111,803,897                  |
| 剰余金             |                          |                                 |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 596,747,982              | 875,472,674                     |
| （分配準備積立金）       | 239,400,584              | 215,590,885                     |
| 元本等合計           | 14,422,734,839           | 13,987,276,571                  |
| 純資産合計           | 14,422,734,839           | 13,987,276,571                  |
| 負債純資産合計         | 14,538,816,612           | 14,093,717,767                  |

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 第7期中間計算期間<br>自 令和 2年 3月26日<br>至 令和 2年 9月25日 | 第8期中間計算期間<br>自 令和 3年 3月26日<br>至 令和 3年 9月25日 |
|-------------------------------------------|---------------------------------------------|---------------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                             |                                             |
| 受取利息                                      | 16,206                                      | 583                                         |
| 有価証券売買等損益                                 | 96,704,301                                  | 399,290,244                                 |
| 営業収益合計                                    | 96,720,507                                  | 399,290,827                                 |
| 営業費用                                      |                                             |                                             |
| 支払利息                                      | 521,918                                     | 30,918                                      |
| 受託者報酬                                     | 3,528,339                                   | 3,142,845                                   |
| 委託者報酬                                     | 89,090,494                                  | 79,356,880                                  |
| その他費用                                     | 317,488                                     | 282,791                                     |
| 営業費用合計                                    | 93,458,239                                  | 82,813,434                                  |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             | 3,262,268                                   | 316,477,393                                 |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             | 3,262,268                                   | 316,477,393                                 |
| 中間純利益又は中間純損失（ ）                           | 3,262,268                                   | 316,477,393                                 |
| 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（ ） | 225,927                                     | 17,588,702                                  |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           | 240,232,216                                 | 596,747,982                                 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 9,793,329                                   | 40,655,712                                  |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 9,793,329                                   | 40,655,712                                  |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 27,476,721                                  | 60,819,711                                  |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 27,476,721                                  | 60,819,711                                  |
| 分配金                                       | -                                           | -                                           |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ）                           | 226,037,019                                 | 875,472,674                                 |

## （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 | 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7期<br>[令和 3年 3月25日現在] | 第8期中間計算期間末<br>[令和 3年 9月25日現在] |
|-----------|------------------------|-------------------------------|
| １．期首元本額   | 16,214,110,504円        | 13,825,986,857円               |
| 期中追加設定元本額 | 1,565,612,291円         | 689,085,874円                  |
| 期中一部解約元本額 | 3,953,735,938円         | 1,403,268,834円                |
| ２．受益権の総数  | 13,825,986,857口        | 13,111,803,897口               |

## （中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 第7期中間計算期間<br>自 令和 2年 3月26日<br>至 令和 2年 9月25日 | 第8期中間計算期間<br>自 令和 3年 3月26日<br>至 令和 3年 9月25日 |
|---------------------------------------------|---------------------------------------------|
| 該当事項はありません。                                 | 該当事項はありません。                                 |

## （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7期<br>[令和 3年 3月25日現在]                                                                                                             | 第8期中間計算期間末<br>[令和 3年 9月25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             | <p>（１）有価証券</p> <p>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。</p> <p>（２）デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>（３）上記以外の金融商品</p> | <p>（１）有価証券</p> <p>同左</p> <p>（２）デリバティブ取引</p> <p>同左</p> <p>（３）上記以外の金融商品</p> |

| 区分                        | 第7期<br>[ 令和 3年 3月25日現在 ]                                                                                                                                                                                   | 第8期中間計算期間末<br>[ 令和 3年 9月25日現在 ] |
|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------|
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>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。</p> <p>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。</p> | <p>同左</p> <p>同左</p>             |

（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7期<br>[ 令和 3年 3月25日現在 ] | 第8期中間計算期間末<br>[ 令和 3年 9月25日現在 ] |
|--------------|--------------------------|---------------------------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.0432円                  | 1.0668円                         |
| (1万口当たり純資産額) | (10,432円)                | (10,668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。

ＴＯＰＩＸマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[ 令和 3年 9月25日現在 ]

資産の部

流動資産

[ 令和 3年 9月25日現在 ]

|             |                 |
|-------------|-----------------|
| コール・ローン     | 103,797,713,258 |
| 株式          | 797,102,869,170 |
| 派生商品評価勘定    | 35,959,600      |
| 未収入金        | 1,799,903,954   |
| 未収配当金       | 192,150,781     |
| 未収利息        | 1,575,143       |
| 前払金         | 293,338,000     |
| その他未収収益     | 21,858,849      |
| 差入委託証拠金     | 573,375,000     |
| 流動資産合計      | 903,818,743,755 |
| 資産合計        | 903,818,743,755 |
| 負債の部        |                 |
| 流動負債        |                 |
| 派生商品評価勘定    | 2,839,350       |
| 未払金         | 4,034,049,430   |
| 未払解約金       | 5,974,471,116   |
| 未払利息        | 13,394          |
| 受入担保金       | 84,349,486,417  |
| 流動負債合計      | 94,360,859,707  |
| 負債合計        | 94,360,859,707  |
| 純資産の部       |                 |
| 元本等         |                 |
| 元本          | 339,315,013,568 |
| 剰余金         |                 |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 470,142,870,480 |
| 元本等合計       | 809,457,884,048 |
| 純資産合計       | 809,457,884,048 |
| 負債純資産合計     | 903,818,743,755 |

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                       |                                                                                                                         |
|-----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法    | 株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。<br>新株予約権証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 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 9月25日現在 ] |
|------------------------|-------------------|
| 1. 期首                  | 令和 3年 3月26日       |
| 期首元本額                  | 229,410,107,801円  |
| 期中追加設定元本額              | 227,152,816,242円  |
| 期中一部解約元本額              | 117,247,910,475円  |
| 元本の内訳                  |                   |
| 三菱ＵＦＪ トピックスインデックスオープン  | 6,214,405,288円    |
| 三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型） | 930,806,675円      |

|                                  | [令和 3年 9月25日現在] |
|----------------------------------|-----------------|
| 三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）         | 3,534,308,439円  |
| 三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）           | 3,240,710,872円  |
| 三菱ＵＦＪ トピックスオープン（確定拠出年金）          | 3,448,560,095円  |
| 三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）      | 7,336,279,267円  |
| 三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）    | 31,263,936,522円 |
| 三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）      | 37,787,193,108円 |
| 三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）        | 118,682,458円    |
| 三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）           | 269,659,412円    |
| ファンド・マネジャー（国内株式）                 | 27,625,923,782円 |
| eMAXIS TOPIXインデックス               | 6,831,015,309円  |
| eMAXIS バランス（８資産均等型）              | 2,027,146,081円  |
| eMAXIS バランス（波乗り型）                | 362,485,451円    |
| 三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）      | 2,303,192,963円  |
| コアバランス                           | 572,753円        |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３０（確定拠出年金） | 378,948,030円    |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４０（確定拠出年金） | 456,495,034円    |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５０（確定拠出年金） | 345,191,764円    |
| eMAXIS Slim 国内株式（TOPIX）          | 17,164,425,350円 |
| 国内株式セレクション（ラップ向け）                | 2,314,308,488円  |
| eMAXIS Slim バランス（８資産均等型）         | 6,089,157,336円  |
| つみたて日本株式（TOPIX）                  | 4,907,872,402円  |
| つみたて８資産均等バランス                    | 2,739,230,576円  |
| つみたて４資産均等バランス                    | 790,480,472円    |
| eMAXIS マイマネージャー １９７０s            | 2,359,169円      |
| eMAXIS マイマネージャー １９８０s            | 3,266,944円      |
| eMAXIS マイマネージャー １９９０s            | 4,154,790円      |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３５（確定拠出年金） | 292,303,936円    |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４５（確定拠出年金） | 251,105,187円    |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５５（確定拠出年金） | 139,369,763円    |
| 三菱ＵＦＪ DC年金バランス（株式１５）             | 243,176,678円    |
| 三菱ＵＦＪ DC年金バランス（株式４０）             | 629,586,003円    |
| 三菱ＵＦＪ DC年金バランス（株式６５）             | 916,833,562円    |
| eMAXIS Slim 全世界株式（３地域均等型）        | 561,562,720円    |
| 三菱ＵＦＪ DC年金インデックス（国内株式）           | 737,827,670円    |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金） | 140,839,529円    |
| 三菱ＵＦＪ DC年金バランス（株式２５）             | 92,502,133円     |
| 国内株式インデックス・オープン（ラップ向け）           | 11,583,243,165円 |

|                                                     | [令和 3年 9月25日現在] |
|-----------------------------------------------------|-----------------|
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６５（確定拠出年金）                    | 25,794,096円     |
| ラップ向けインデックスｆ 国内株式                                   | 2,631,912,135円  |
| ＭＵＦＧ ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）                           | 33,418,004円     |
| ＭＵＦＧ ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）                           | 168,222,158円    |
| ＭＵＦＧ ウェルス・インサイト・ファンド（積極型）                           | 118,838,776円    |
| 三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）                           | 1,743,472,380円  |
| 三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）                           | 3,491,448,068円  |
| 三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）                          | 300,480,002円    |
| 三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）                      | 1,101,885,338円  |
| 三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）                           | 641,925,440円    |
| 三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）                              | 20,539,362円     |
| 三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）                            | 124,717,775円    |
| ｅＭＡＸＩＳ バランス（４資産均等型）                                 | 450,542,788円    |
| ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイゴールキーパー）                           | 123,354,771円    |
| ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）                           | 138,229,331円    |
| ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）                          | 466,873,619円    |
| ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）                             | 374,636,527円    |
| ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）                            | 727,789,883円    |
| 三菱ＵＦＪ トピックスオープン                                     | 1,066,371,660円  |
| 三菱ＵＦＪ ＤＣトピックスオープン                                   | 9,823,665,862円  |
| 三菱ＵＦＪ トピックスオープンＶＡ（適格機関投資家限定）                        | 84,736,656円     |
| 三菱ＵＦＪ トピックスインデックスファンドＶＡ（適格機関投資家限定）                  | 7,879,004,590円  |
| 三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）ＶＡ（適格機関投資家限定）               | 60,865円         |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）                       | 26,089,213円     |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）                       | 6,393,167,794円  |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）                     | 151,745,445円    |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）                     | 1,891,474,327円  |
| ＭＵＡＭ 日本株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）                      | 34,080,098,132円 |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）                     | 313,765,031円    |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）                       | 4,264,652円      |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）                     | 1,323,224円      |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）                       | 303,663,021円    |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）                       | 611,801,188円    |
| ＭＵＡＭトピックスリスクコントロール（５％）インデックスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）  | 1,795,614円      |
| ＭＵＡＭトピックスリスクコントロール（１０％）インデックスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定） | 4,896,429円      |

|                                           | [令和 3年 9月25日現在] |
|-------------------------------------------|-----------------|
| MUAM インデックスファンドTOPIX i（適格機関投資家限定）         | 8,726,654円      |
| MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）   | 4,233,536,206円  |
| MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）  | 1,605,172,276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）     | 572,868,337円    |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）                | 77,561,693円     |
| MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）         | 3,742,230,115円  |
| MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）   | 170,614,788円    |
| MUKAM 日本株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）          | 2,602,788,896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）       | 441,640,305円    |
| MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付） | 138,601,640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）                | 197,208円        |
| MUKAM 米国国債プラス日本株式ファンド2019-04（適格機関投資家限定）   | 141,797,701円    |
| MUKAM 米国国債プラス日本株式ファンド2019-11（適格機関投資家限定）   | 138,824,195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）   | 46,429,550円     |
| MUKAM 米国国債プラス日本株式ファンド2020-07（適格機関投資家限定）   | 132,841,516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）   | 44,538,578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）   | 44,528,647円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01（適格機関投資家限定）   | 42,496,065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）   | 40,946,418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）   | 42,775,442円     |
| MUKAM 日米コアバランス 2021-07（適格機関投資家限定）         | 576,226,759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）   | 41,544,745円     |
| アセットアロケーションファンド2021-09適格限定                | 38,386,516円     |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンド                          | 5,490,254,626円  |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA                | 3,349,051円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA              | 13,215,862円     |

|                                                  | [令和 3年 9月25日現在]  |
|--------------------------------------------------|------------------|
| インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ                       | 5,197,652円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ                       | 11,417,994円      |
| 三菱ＵＦＪ ＴＯＰＩＸ・ファンドＶＡ１                              | 705,473,024円     |
| 三菱ＵＦＪ ＴＯＰＩＸ・ファンドＶＡ                               | 157,833,024円     |
| 三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）                       | 11,295,096円      |
| 三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）                       | 77,316,081円      |
| 三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）                       | 9,084,431円       |
| 三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）                       | 44,988,720円      |
| 三菱ＵＦＪ <ＤＣ>ＴＯＰＩＸ・ファンド                             | 1,582,086,587円   |
| 三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド<br>（安定型）          | 430,743,125円     |
| 三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド<br>（安定成長型）        | 1,726,839,526円   |
| 三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド<br>（成長型）          | 1,616,345,491円   |
| 三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド<br>（積極型）          | 1,377,754,066円   |
| 三菱ＵＦＪ ＤＣ国内株式インデックスファンド                           | 51,725,421,630円  |
| 合計                                               | 339,315,013,568円 |
| ２．貸付有価証券<br>貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っております。<br>株式 | 81,110,266,520円  |
| ３．受益権の総数                                         | 339,315,013,568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 9月25日現在]                                                                                                                                                                                                                 |
|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| １．貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                                                                                                                                          |
| ２．時価の算定方法                 | <p>（１）有価証券</p> <p>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。</p> <p>（２）デリバティブ取引</p> <p>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。</p> <p>（３）上記以外の金融商品</p> <p>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。</p> |
| 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

株式関連

[ 令和 3年 9月25日現在 ]

| 区分   | 種類             | 契約額等（円）        |       | 時価（円）          | 評価損益（円）    |
|------|----------------|----------------|-------|----------------|------------|
|      |                |                | うち1年超 |                |            |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建 | 12,143,333,000 | —     | 12,176,775,000 | 33,442,000 |
| 合計   |                | 12,143,333,000 | —     | 12,176,775,000 | 33,442,000 |

（注）時価の算定方法

- 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。
- 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 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 9月25日現在 ] |
|--------------|-------------------|
| 1口当たり純資産額    | 2.3856円           |
| (1万口当たり純資産額) | (23,856円)         |

外国株式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 9月25日現在 ]

|          |                   |
|----------|-------------------|
| 資産の部     |                   |
| 流動資産     |                   |
| 預金       | 20,876,734,258    |
| コール・ローン  | 4,981,042,919     |
| 株式       | 1,082,642,279,282 |
| 投資証券     | 24,946,065,316    |
| 派生商品評価勘定 | 28,735,891        |
| 未収入金     | 9,214,879         |
| 未収配当金    | 1,038,704,345     |
| 差入委託証拠金  | 7,967,324,718     |
| 流動資産合計   | 1,142,490,101,608 |

[ 令和 3年 9月25日現在 ]

|             |                   |
|-------------|-------------------|
| 資産合計        | 1,142,490,101,608 |
| 負債の部        |                   |
| 流動負債        |                   |
| 派生商品評価勘定    | 135,645,966       |
| 未払解約金       | 6,283,662,471     |
| 未払利息        | 642               |
| 流動負債合計      | 6,419,309,079     |
| 負債合計        | 6,419,309,079     |
| 純資産の部       |                   |
| 元本等         |                   |
| 元本          | 264,986,626,807   |
| 剰余金         |                   |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 871,084,165,722   |
| 元本等合計       | 1,136,070,792,529 |
| 純資産合計       | 1,136,070,792,529 |
| 負債純資産合計     | 1,142,490,101,608 |

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                            |                                                                                                                      |
|----------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。<br>投資証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法      | 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。<br>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<br>「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 9月25日現在 ] |
|----------------------------|-------------------|
| 1. 期首                      | 令和 3年 3月26日       |
| 期首元本額                      | 239,184,802,487円  |
| 期中追加設定元本額                  | 76,344,775,109円   |
| 期中一部解約元本額                  | 50,542,950,789円   |
| 元本の内訳                      |                   |
| MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信   | 3,221,302,398円    |
| MAXIS 全世界株式（オール・カントリー）上場投信 | 1,825,789,478円    |
| ファンド・マネジャー（海外株式）           | 19,244,277円       |
| eMAXIS 先進国株式インデックス         | 11,879,319,054円   |
| eMAXIS バランス（8資産均等型）        | 1,106,986,675円    |
| eMAXIS バランス（波乗り型）          | 168,160,788円      |
| コアバランス                     | 133,271円          |

|                                  | [令和 3年 9月25日現在] |
|----------------------------------|-----------------|
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３０（確定拠出年金） | 91,374,852円     |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４０（確定拠出年金） | 128,184,551円    |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５０（確定拠出年金） | 96,787,285円     |
| eMAXIS Slim 先進国株式インデックス          | 57,837,924,060円 |
| 海外株式セレクション（ラップ向け）                | 1,363,224,137円  |
| eMAXIS Slim バランス（８資産均等型）         | 3,348,910,677円  |
| つみたて先進国株式                        | 10,327,469,942円 |
| つみたて８資産均等バランス                    | 1,504,681,861円  |
| つみたて４資産均等バランス                    | 445,872,485円    |
| eMAXIS マイマネージャー １９７０s            | 1,537,105円      |
| eMAXIS マイマネージャー １９８０s            | 2,111,218円      |
| eMAXIS マイマネージャー １９９０s            | 2,747,416円      |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３５（確定拠出年金） | 82,157,544円     |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４５（確定拠出年金） | 70,575,528円     |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５５（確定拠出年金） | 38,185,754円     |
| eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）          | 17,372,651,843円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式（３地域均等型）        | 314,571,828円    |
| eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）     | 53,601,735,779円 |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金） | 40,336,239円     |
| 先進国株式インデックスファンド（ラップ向け）           | 9,715,918,527円  |
| つみたて全世界株式                        | 28,612,772円     |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６５（確定拠出年金） | 7,469,176円      |
| ラップ向けインデックスf 先進国株式               | 2,433,330,779円  |
| 三菱ＵＦＪ DC海外株式インデックスファンド           | 22,455,314,895円 |
| eMAXIS 全世界株式インデックス               | 3,126,024,053円  |
| 三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）        | 1,146,560,059円  |
| 三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）        | 2,201,042,502円  |
| 三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）       | 162,616,383円    |
| 三菱ＵＦＪ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）   | 723,559,726円    |
| 三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）        | 361,962,040円    |
| eMAXIS バランス（４資産均等型）              | 250,322,461円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）        | 69,419,037円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）        | 81,978,140円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）       | 301,861,232円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）          | 236,192,756円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）         | 478,128,477円    |

|                                            | [令和 3年 9月25日現在] |
|--------------------------------------------|-----------------|
| 三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）              | 16,818,311円     |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）              | 5,944,363,824円  |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）            | 81,708,796円     |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）            | 1,050,110,178円  |
| MUAM 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）             | 12,915,577,630円 |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）            | 737,585円        |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）              | 847,921,389円    |
| MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）            | 6,518,355,786円  |
| アドバンスト・バランス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）              | 13,005,694円     |
| アドバンスト・バランス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）              | 73,552,599円     |
| MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）    | 2,757,342,337円  |
| MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）   | 1,045,311,999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）      | 381,214,204円    |
| 世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）                 | 49,964,930円     |
| MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）          | 1,960,438,412円  |
| MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）    | 94,643,843円     |
| MUKAM 外国株式インデックスファンド２（適格機関投資家限定）           | 2,202,654,887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）        | 290,051,282円    |
| MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定） | 10,331,777,747円 |
| MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）２（適格機関投資家転売制限付）  | 90,320,642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）                 | 105,607円        |
| 三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンド                       | 2,131,778,431円  |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ                 | 961,065円        |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ               | 3,558,113円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ                 | 1,584,089円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ                 | 3,982,575円      |
| 三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンドＶＡ                     | 36,904,572円     |
| 三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）                 | 3,168,068円      |
| 三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）                 | 21,728,769円     |
| 三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）                 | 4,838,380円      |
| 三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）                 | 25,190,147円     |
| 三菱ＵＦＪ <ＤＣ>外国株式インデックスファンド                   | 5,834,452,963円  |

|                                           | [令和 3年 9月25日現在]  |
|-------------------------------------------|------------------|
| 三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド<br>（安定型）   | 119,478,472円     |
| 三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド<br>（安定成長型） | 478,386,030円     |
| 三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド<br>（成長型）   | 500,058,844円     |
| 三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド<br>（積極型）   | 482,289,547円     |
| 合計                                        | 264,986,626,807円 |
| 2. 受益権の総数                                 | 264,986,626,807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 9月25日現在]                                                                                                                                                                                                                 |
|--------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差<br>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                     | <p>（１）有価証券</p> <p>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。</p> <p>（２）デリバティブ取引</p> <p>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。</p> <p>（３）上記以外の金融商品</p> <p>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。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項につ<br>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

株式関連

[令和 3年 9月25日現在]

| 区分   | 種類       | 契約額等（円） |       | 時価（円） | 評価損益（円） |
|------|----------|---------|-------|-------|---------|
|      |          |         | うち1年超 |       |         |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 |         |       |       |         |

|  |    |                |   |                |            |
|--|----|----------------|---|----------------|------------|
|  | 買建 | 29,755,972,900 | — | 29,666,123,759 | 89,849,141 |
|  | 合計 | 29,755,972,900 | — | 29,666,123,759 | 89,849,141 |

## （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 9月25日現在 ]

| 区分        | 種類         | 契約額等（円）       |       | 時価（円）         | 評価損益（円）    |
|-----------|------------|---------------|-------|---------------|------------|
|           |            |               | うち1年超 |               |            |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引     |               |       |               |            |
|           | 買建         |               |       |               |            |
|           | アメリカドル     | 1,161,581,132 | —     | 1,162,480,144 | 899,012    |
|           | カナダドル      | 58,583,668    | —     | 58,582,393    | 1,275      |
|           | オーストラリアドル  | 65,035,172    | —     | 65,036,140    | 968        |
|           | イギリスポンド    | 92,365,081    | —     | 92,364,654    | 427        |
|           | スイスフラン     | 36,554,148    | —     | 36,554,056    | 92         |
|           | 香港ドル       | 24,162,720    | —     | 24,162,720    | —          |
|           | スウェーデンクローネ | 22,464,351    | —     | 22,464,000    | 351        |
|           | ユーロ        | 129,696,000   | —     | 129,695,200   | 800        |
|           | 売建         |               |       |               |            |
|           | アメリカドル     | 1,094,240,113 | —     | 1,106,178,753 | 11,938,640 |
|           | カナダドル      | 49,470,407    | —     | 50,725,425    | 1,255,018  |
|           | イギリスポンド    | 92,607,867    | —     | 94,185,269    | 1,577,402  |
|           | スイスフラン     | 44,080,394    | —     | 44,557,013    | 476,619    |
|           | 香港ドル       | 43,250,750    | —     | 43,646,040    | 395,290    |
|           | シンガポールドル   | 48,324,325    | —     | 49,038,392    | 714,067    |
|           | スウェーデンクローネ | 24,145,622    | —     | 24,627,200    | 481,578    |
|           | ユーロ        | 82,922,292    | —     | 84,041,647    | 1,119,355  |
|           | 合計         | 3,069,484,042 | —     | 3,088,339,046 | 17,060,934 |

## （注）時価の算定方法

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

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 9月25日現在 ] |
|--------------|-------------------|
| 1口当たり純資産額    | 4.2873円           |
| (1万口当たり純資産額) | (42,873円)         |

## 国内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 9月25日現在 ]

|             |                 |
|-------------|-----------------|
| 資産の部        |                 |
| 流動資産        |                 |
| コール・ローン     | 1,807,492,196   |
| 国債証券        | 158,283,856,500 |
| 地方債証券       | 10,953,192,810  |
| 特殊債券        | 9,969,151,349   |
| 社債券         | 11,278,793,700  |
| 未収入金        | 315,365,700     |
| 未収利息        | 160,566,891     |
| 前払費用        | 12,890,191      |
| 差入委託証拠金     | 3,600,000       |
| 流動資産合計      | 192,784,909,337 |
| 資産合計        | 192,784,909,337 |
| 負債の部        |                 |
| 流動負債        |                 |
| 派生商品評価勘定    | 1,055,500       |
| 前受金         | 150,000         |
| 未払金         | 2,302,456,100   |
| 未払解約金       | 1,000,614,840   |
| 未払利息        | 233             |
| 流動負債合計      | 3,304,276,673   |
| 負債合計        | 3,304,276,673   |
| 純資産の部       |                 |
| 元本等         |                 |
| 元本          | 193,307,644,945 |
| 剰余金         |                 |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 3,827,012,281   |
| 元本等合計       | 189,480,632,664 |
| 純資産合計       | 189,480,632,664 |
| 負債純資産合計     | 192,784,909,337 |

### 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 9月25日現在]  |
|--------------------------------------------|------------------|
| 1. 期首                                      | 令和 3年 3月26日      |
| 期首元本額                                      | 153,713,789,372円 |
| 期中追加設定元本額                                  | 156,823,754,247円 |
| 期中一部解約元本額                                  | 117,229,898,674円 |
| 元本の内訳                                      |                  |
| ファンド・マネジャー（国内債券）                           | 40,118,417円      |
| 三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）                  | 8,383,780,062円   |
| 三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）                  | 212,874,313円     |
| 三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）                 | 1,284,392,706円   |
| 三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）             | 5,197,005,071円   |
| 三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）                  | 7,247,955,006円   |
| ＭＵＫＡＭ バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）    | 19,952,066,429円  |
| ＭＵＫＡＭ バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）   | 7,677,230,658円   |
| ＭＵＫＡＭ 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）          | 20,293,219,441円  |
| ＭＵＫＡＭ バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）    | 1,906,258,910円   |
| ＭＵＫＡＭ 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）            | 47,097,125,900円  |
| ＭＵＫＡＭ 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定） | 73,351,892,602円  |
| ＭＵＫＡＭ バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付）  | 663,725,430円     |
| 合計                                         | 193,307,644,945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。                | 3,827,012,281円   |
| 3. 受益権の総数                                  | 193,307,644,945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 9月25日現在 ]                                                                                                                                                                                                                        |
|----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はあります。                                                                                                                                                                                                                    |
| 2. 時価の算定方法                 | <p>( 1 ) 有価証券</p> <p>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。</p> <p>( 2 ) デリバティブ取引</p> <p>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。</p> <p>( 3 ) 上記以外の金融商品</p> <p>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。</p> |
| 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 9月25日現在 ]

| 区分   | 種類           | 契約額等（円）     |       | 時価（円）       | 評価損益（円）   |
|------|--------------|-------------|-------|-------------|-----------|
|      |              |             | うち1年超 |             |           |
| 市場取引 | 債券先物取引<br>買建 | 759,150,000 | —     | 758,100,000 | 1,050,000 |
| 合計   |              | 759,150,000 | —     | 758,100,000 | 1,050,000 |

（注）時価の算定方法

- 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。
- 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 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 9月25日現在 ] |
|--------------|-------------------|
| 1口当たり純資産額    | 0.9802円           |
| (1万口当たり純資産額) | (9,802円)          |

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

[ 令和 3年 9月25日現在 ]

|             |                 |
|-------------|-----------------|
| 資産の部        |                 |
| 流動資産        |                 |
| 預金          | 382,117,446     |
| コール・ローン     | 4,084,159,240   |
| 国債証券        | 279,578,918,328 |
| 派生商品評価勘定    | 236,665,250     |
| 未収入金        | 134,209         |
| 未収利息        | 1,665,649,768   |
| 前払費用        | 97,804,364      |
| 流動資産合計      | 286,045,448,605 |
| 資産合計        | 286,045,448,605 |
| 負債の部        |                 |
| 流動負債        |                 |
| 派生商品評価勘定    | 808,189,789     |
| 未払金         | 2,451,985,872   |
| 未払解約金       | 168,969,754     |
| 未払利息        | 527             |
| 流動負債合計      | 3,429,145,942   |
| 負債合計        | 3,429,145,942   |
| 純資産の部       |                 |
| 元本等         |                 |
| 元本          | 204,917,044,136 |
| 剰余金         |                 |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 77,699,258,527  |
| 元本等合計       | 282,616,302,663 |
| 純資産合計       | 282,616,302,663 |
| 負債純資産合計     | 286,045,448,605 |

## 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<br>「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 9月25日現在 ] |
| 1. 期首 | 令和 3年 3月26日       |

|                                               | [令和 3年 9月25日現在]  |
|-----------------------------------------------|------------------|
| 期首元本額                                         | 189,589,551,791円 |
| 期中追加設定元本額                                     | 25,923,672,420円  |
| 期中一部解約元本額                                     | 10,596,180,075円  |
| 元本の内訳                                         |                  |
| e M A X I S 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）              | 171,053,091円     |
| 三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）                     | 4,401,329,994円   |
| 三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）                     | 4,384,731,106円   |
| 三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）                    | 900,925,837円     |
| 三菱ＵＦＪ D Cバランス・イノベーション（K A K U S H I N）        | 2,782,310,843円   |
| 三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）                     | 2,533,332,858円   |
| e M A X I S 債券バランス（２資産均等型）                    | 67,409,176円      |
| M U A M ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）      | 118,168,572,454円 |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）                 | 10,499,032,054円  |
| M U K A M バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）   | 10,730,403,072円  |
| M U K A M バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）  | 4,023,255,023円   |
| M U K A M スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）     | 1,330,243,316円   |
| M U K A M 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）         | 9,552,497,106円   |
| M U K A M バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）   | 662,103,678円     |
| M U K A M ヘッジ付外国債券インデックスファンド２（適格機関投資家限定）      | 10,112,332,110円  |
| M U K A M ヘッジ付外国債券インデックスオープン（適格機関投資家限定）       | 7,540,992,758円   |
| M U K A M スマート・クオリティ・セレクション２（適格機関投資家限定）       | 1,059,565,366円   |
| M U K A M バランス・イノベーション（リスク抑制型）２（適格機関投資家転売制限付） | 348,078,768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）                    | 2,238,463円       |
| M U K A M バランスファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）          | 2,234,898,466円   |
| M U K A M 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）   | 312,015,642円     |
| M U K A M バランスファンド２０２０－０４（適格機関投資家限定）          | 2,291,773,815円   |
| M U K A M バランスファンド２０２０－０７（適格機関投資家限定）          | 2,184,344,382円   |
| M U K A M 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）   | 311,241,135円     |
| M U K A M バランスファンド２０２０－１０（適格機関投資家限定）          | 2,173,330,088円   |

|                                         | [令和 3年 9月25日現在]  |
|-----------------------------------------|------------------|
| 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） | 311,484,137円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01（適格機関投資家限定） | 312,660,303円     |
| MUKAM バランスファンド2021-03（適格機関投資家限定）        | 2,118,938,164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） | 321,148,921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） | 324,353,289円     |
| MUKAM バランスファンド2021-06（適格機関投資家限定）        | 2,116,614,767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） | 317,340,372円     |
| アセットアロケーションファンド2021-09適格限定              | 316,493,582円     |
| 合計                                      | 204,917,044,136円 |
| 2. 受益権の総数                               | 204,917,044,136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 9月25日現在]                                                                                                                                                                                                                 |
|----------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                                                                                                                                          |
| 2. 時価の算定方法                 | <p>（１）有価証券</p> <p>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。</p> <p>（２）デリバティブ取引</p> <p>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。</p> <p>（３）上記以外の金融商品</p> <p>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。</p> |
| 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 9月25日現在 ]

| 区分        | 種類         | 契約額等（円）         |       | 時価（円）           | 評価損益（円）     |
|-----------|------------|-----------------|-------|-----------------|-------------|
|           |            |                 | うち1年超 |                 |             |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引     |                 |       |                 |             |
|           | 買建         |                 |       |                 |             |
|           | アメリカドル     | 1,190,459,850   | —     | 1,203,448,290   | 12,988,440  |
|           | カナダドル      | 15,326,460      | —     | 15,715,278      | 388,818     |
|           | オーストラリアドル  | 52,929,162      | —     | 54,062,300      | 1,133,138   |
|           | イギリスポンド    | 110,353,980     | —     | 112,233,654     | 1,879,674   |
|           | デンマーククローネ  | 13,252,547      | —     | 13,428,800      | 176,253     |
|           | ユーロ        | 1,036,528,650   | —     | 1,050,520,590   | 13,991,940  |
|           | 売建         |                 |       |                 |             |
|           | アメリカドル     | 129,898,041,105 | —     | 130,596,694,439 | 698,653,334 |
|           | カナダドル      | 5,570,194,920   | —     | 5,574,939,684   | 4,744,764   |
|           | オーストラリアドル  | 5,291,028,213   | —     | 5,314,243,400   | 23,215,187  |
|           | イギリスポンド    | 17,721,071,514  | —     | 17,738,083,424  | 17,011,910  |
|           | シンガポールドル   | 1,254,988,370   | —     | 1,256,541,790   | 1,553,420   |
|           | マレーシアリンギット | 1,416,451,020   | —     | 1,410,801,300   | 5,649,720   |
|           | スウェーデンクローネ | 814,565,880     | —     | 816,128,000     | 1,562,120   |
|           | ノルウェークローネ  | 717,408,990     | —     | 726,640,200     | 9,231,210   |
|           | デンマーククローネ  | 1,353,124,001   | —     | 1,350,379,200   | 2,744,801   |
|           | メキシコペソ     | 2,026,072,917   | —     | 2,048,315,346   | 22,242,429  |
|           | イスラエルシェケル  | 1,304,040,592   | —     | 1,319,141,442   | 15,100,850  |
|           | ポーランドズロチ   | 1,634,968,210   | —     | 1,613,117,860   | 21,850,350  |
|           | ユーロ        | 113,857,095,187 | —     | 113,696,107,636 | 160,987,551 |
| 合計        |            | 285,277,901,568 | —     | 285,910,542,633 | 571,524,539 |

## （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 9月25日現在 ] |
|--------------|-------------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.3792円           |
| (1万口当たり純資産額) | (13,792円)         |

#### 4【委託会社等の概況】

##### （１）【資本金の額】

2021年9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年間に於ける資本金の額の増減はありません。

##### （２）【事業の内容及び営業の状況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

2021年 9月30日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

| 商品分類       | 本 数<br>( 本 ) | 純資産総額<br>( 百万円 ) |
|------------|--------------|------------------|
| 追加型株式投資信託  | 880          | 18,099,410       |
| 追加型公社債投資信託 | 16           | 1,434,834        |
| 単位型株式投資信託  | 83           | 363,686          |
| 単位型公社債投資信託 | 47           | 185,741          |
| 合 計        | 1,026        | 20,083,672       |

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）【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

## ５【委託会社等の経理状況】

### （１）財務諸表の作成方法について

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

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

### （２）監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第36期事業年度（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

### （１）【貸借対照表】

（単位：千円）

|           | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) |            | 第36期<br>(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<br>(令和2年3月31日現在) | 第36期<br>(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<br>(令和2年3月31日現在) | 第36期<br>(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<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日 ) | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>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<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>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<br>準備金 | 利益剰余金     |             |             | 株主資本合計     |
|       |           | 資本<br>準備金 | その他<br>資本剰余金 | 資本<br>剰余金合計 |           | その他利益剰余金  |             | 利益剰余金<br>合計 |            |
|       |           |           |              |             |           | 別途<br>積立金 | 繰越利益<br>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<br>項目の当期変動額<br>(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<br>有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>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<br>項目の当期変動額<br>(純額) | 1,124,917            | 1,124,917      | 1,124,917  |
| 当期変動額合計                     | 1,124,917            | 1,124,917      | 1,346,907  |
| 当期末残高                       | 1,815                | 1,815          | 79,922,854 |

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

(単位：千円)

|                             | 株主資本      |           |              |             |           |           |             |             |            |
|-----------------------------|-----------|-----------|--------------|-------------|-----------|-----------|-------------|-------------|------------|
|                             | 資本金       | 資本剰余金     |              |             | 利益剰余金     |           |             |             | 株主資本合計     |
|                             |           | 資本<br>準備金 | その他<br>資本剰余金 | 資本<br>剰余金合計 | 利益<br>準備金 | その他利益剰余金  |             | 利益剰余金<br>合計 |            |
|                             |           |           |              |             |           | 別途<br>積立金 | 繰越利益<br>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<br>項目の当期変動額<br>(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<br>有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>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<br>項目の当期変動額<br>(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<br>(令和2年3月31日現在) | 第36期<br>(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<br>(令和2年3月31日現在) | 第36期<br>(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<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>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<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>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<br>株式数（株） | 当事業年度増加<br>株式数（株） | 当事業年度減少<br>株式数（株） | 当事業年度末<br>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<br>株式数（株） | 当事業年度増加<br>株式数（株） | 当事業年度減少<br>株式数（株） | 当事業年度末<br>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<br>( 令和2年3月31日現在 ) | 第36期<br>( 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<br>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<br>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<br>(令和2年3月31日現在) | 第36期<br>(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<br>5年以内 | 5年超<br>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<br>5年以内 | 5年超<br>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<br>（千円） | 取得原価<br>（千円） | 差額（千円）    |
|-----------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるものの  | 株式  | -                | -            | -         |
|                       | 債券  | -                | -            | -         |
|                       | その他 | 9,859,345        | 8,694,010    | 1,165,334 |
|                       | 小計  | 9,859,345        | 8,694,010    | 1,165,334 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないものの | 株式  | -                | -            | -         |
|                       | 債券  | -                | -            | -         |
|                       | その他 | 8,874,369        | 10,037,087   | 1,162,718 |
|                       | 小計  | 8,874,369        | 10,037,087   | 1,162,718 |
| 合計                    |     | 18,733,714       | 18,731,098   | 2,616     |

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

非上場株式（貸借対照表計上額は31,360千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、含めておりません。

第36期(令和3年3月31日現在)

|  | 種類 | 貸借対照表計上額<br>（千円） | 取得原価<br>（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<br>（自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日） | 第36期<br>（自 令和2年4月1日<br>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<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>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<br>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<br>(令和2年3月31日現在) | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) |
|---------------------|-----------------------|-----------------------|
| 積立型制度の<br>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<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>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<br>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<br>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<br>(令和2年3月31日現在) | 第36期<br>(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<br>(令和2年3月31日現在) | 第36期<br>(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<br>(令和2年3月31日現在) | 第36期<br>(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<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者との関係                     | 取引の内容                     | 取引金額<br>(注4)    | 科目     | 期末残高<br>(注4)    |
|-----|------------------------------|-----------------|------------------|-------------|------------------------|-------------------------------|---------------------------|-----------------|--------|-----------------|
| 親会社 | (株)三菱UFJ<br>フィナンシャル・<br>グループ | 東京都<br>千代田<br>区 | 2,141,513<br>百万円 | 銀行持株<br>会社業 | 被所有<br>間接<br>100.0%    | 連結納税                          | 連結納税に伴う支払<br>(注1)         | 3,030,180<br>千円 | その他未払金 | 3,029,426<br>千円 |
| 親会社 | 三菱UFJ<br>信託銀行(株)             | 東京都<br>千代田<br>区 | 324,279<br>百万円   | 信託業、<br>銀行業 | 被所有<br>直接<br>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<br>(注2) | 5,234,629<br>千円 | 未払手数料  | 712,210<br>千円   |
|     |                              |                 |                  |             |                        | 投資の助言<br>役員の兼任                | 投資助言料<br>(注3)             | 583,270<br>千円   | 未払費用   | 302,681<br>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<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係                                 | 取引の内容                                 | 取引金額<br>(注4)    | 科目     | 期末残高<br>(注4)    |
|-----|----------------------------|-----------------|------------------|-------------|------------------------|-----------------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|--------|-----------------|
| 親会社 | ㈱三菱UFJ<br>フィナンシャル・<br>グループ | 東京都<br>千代田<br>区 | 2,141,513<br>百万円 | 銀行持株<br>会社業 | 被所有<br>間接<br>100.0%    | 連結納税                                          | 連結納税に<br>伴う支払<br>(注1)                 | 3,492,898<br>千円 | その他未払金 | 3,425,136<br>千円 |
| 親会社 | 三菱UFJ<br>信託銀行㈱             | 東京都<br>千代田<br>区 | 324,279<br>百万円   | 信託業、<br>銀行業 | 被所有<br>直接<br>100.0%    | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料の<br>支払<br>(注2) | 5,128,270<br>千円 | 未払手数料  | 772,495<br>千円   |
|     |                            |                 |                  |             |                        | 投資の助言<br><br>役員の兼任                            | 投資助言料<br>(注3)                         | 523,327<br>千円   | 未払費用   | 290,120<br>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<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係                                 | 取引の内容                                 | 取引金額<br>(注3)     | 科目         | 期末残高<br>(注3)     |
|-------------|--------------------------------|-----------------|------------------|-------|------------------------|-----------------------------------------------|---------------------------------------|------------------|------------|------------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | ㈱三菱UFJ<br>銀行                   | 東京都<br>千代田<br>区 | 1,711,958<br>百万円 | 銀行業   | なし                     | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料<br>の支払<br>(注1) | 4,073,855<br>千円  | 未払手数料      | 697,109<br>千円    |
|             |                                |                 |                  |       |                        | 取引銀行                                          | コーラブル<br>預金の払戻<br>(注2)                | 20,000,000<br>千円 |            |                  |
|             |                                |                 |                  |       |                        |                                               | コーラブル<br>預金の預入<br>(注2)                | 20,000,000<br>千円 | 現金及び<br>預金 | 20,000,000<br>千円 |
|             |                                |                 |                  |       |                        |                                               | コーラブル<br>預金に係る<br>受取利息<br>(注2)        | 4,126<br>千円      | 未収収益       | 997<br>千円        |
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJ<br>モルガン・<br>スタンレー<br>証券㈱ | 東京都<br>千代田<br>区 | 40,500<br>百万円    | 証券業   | なし                     | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料<br>の支払<br>(注1) | 5,714,501<br>千円  | 未払手数料      | 944,351<br>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<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係 | 取引の内容 | 取引金額<br>(注3) | 科目 | 期末残高<br>(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<br>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<br>千円 | 未払手数料 | 764,501<br>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<br>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<br>千円 | 未払手数料 | 1,193,245<br>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<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>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<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>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                             |

# 独立監査人の監査報告書

令和3年6月28日

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ  
東京事務所指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

青木 裕晃 印

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

伊藤 鉄也 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱ＵＦＪ国際投信株式会社の令和2年4月1日から令和3年3月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

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

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

## 独立監査人の中間監査報告書

令和３年10月27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」に掲げられている三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）の令和３年３月26日から令和３年９月25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、三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）の令和３年９月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（令和３年３月26日から令和３年９月25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。