【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年5月6日提出
【発行者名】	三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 横川　直
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目１２番１号
【事務連絡者氏名】	伊藤　晃
【電話番号】	03-6250-4740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	国内債券セレクション（ラップ向け）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	１兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

国内債券セレクション（ラップ向け）（「ファンド」といいます。）

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。
信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。
ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（3）【発行（売出）価額の総額】

１兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。
基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。
なお、下記においてもご照会いただけます。
三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
お客様専用フリーダイヤル　0120-151034（受付時間：営業日の9:00～17:00）
ホームページアドレス　https://www.am.mufg.jp/
（注）基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。
なお、便宜上１万口当たりに換算した価額で表示することがあります。

（5）【申込手数料】

ありません。

（6）【申込単位】

販売会社が定める単位
申込単位は販売会社にご確認ください。

（7）【申込期間】

2022年 5月 7日から2023年 5月 2日まで
※申込期間は、前記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新される予定です。

（8）【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。
販売会社は、下記にてご確認いただけます。
三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

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

（９）【払込期日】

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。
各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

（１０）【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

（１１）【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

当ファンドは、ラップ口座に係る契約※に基づいてラップ口座の資金を運用するためのファンドであり、当ファンドの取得申込者は、販売会社にラップ口座を開設のうえ申込みを行うものとします。
※同様の権利義務関係を規定する契約の名称は販売会社によって異なります。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、主として利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざして運用を行います。
信託金の限度額は、5,000億円です。
＊委託会社は、受託会社と合意のうえ、信託金の限度額を変更することができます。
当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

商品分類表

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

属性区分表

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

※当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でご覧いただけます。
※ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

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

商品分類の定義

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

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

属性区分の定義

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

		公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（ＢＢＢ格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（ＢＢ格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信		信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他資産		信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
	資産複合		信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。
決算頻度	年１回		信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年２回		信託約款において、年２回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年４回		信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年６回（隔月）		信託約款において、年６回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年12回（毎月）		信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々		信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他		上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル		信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本		信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米		信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州		信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア		信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア		信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米		信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ		信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）		信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング		信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド		信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。

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

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

［ファンドの目的・特色］

ファンドの目的

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

ファンドの特色

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

● 投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。なお、2022年5月7日現在、投資対象となっている投資信託証券は以下の通りです。

<日本債券インデックスマザーファンド>

日本の公社債への投資を行います。

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

<先進国高格付国債マザーファンド>

日本を含む先進国の国債等への投資を行います。

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

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

<MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド>

世界主要国（日本を除く）の公社債への投資を行います。

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

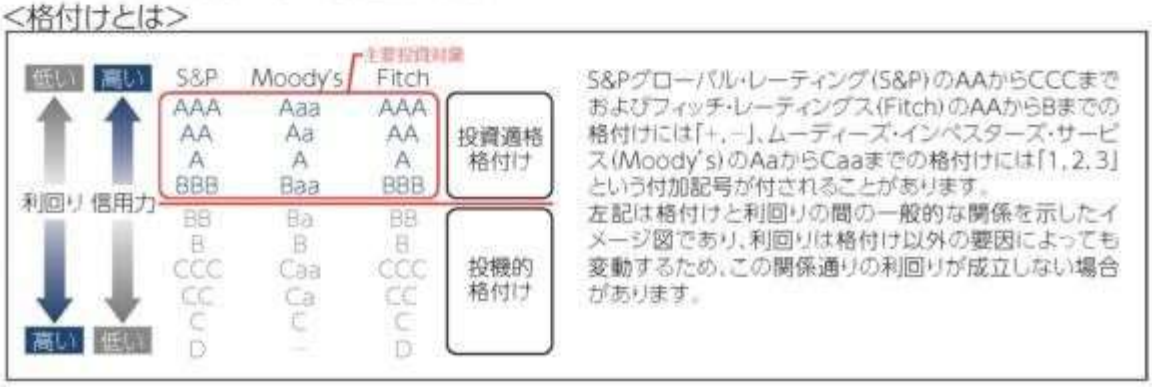
<ショートデュレーション円インカムマザーファンド>

日本を含む先進国の債券等への投資を行います。

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

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

<格付けとは>



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

<三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド>

日本の公社債を主要投資対象とします。

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

<フランス国債7-10年ラダーマザーファンド>

フランスの国債を主要投資対象とします。

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

<ヘッジ付スペイン国債7-10年ラダーマザーファンド>

スペインの国債を主要投資対象とします。

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

<日本超長期国債インデックスマザーファンド>

日本の国債を主要投資対象とします。

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

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

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

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

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

マッコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・リミテッド

- マッコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・リミテッドは、マッコーリー・グループの資産運用部門であるマッコーリー・アセット・マネジメントを形成する1社です。
- マッコーリー・グループは、1969年設立のオーストラリアのシドニーに本拠を構え、銀行業務、証券業務、投資銀行業務、資産運用業務など各種金融サービスをグローバルに提供する金融グループです。

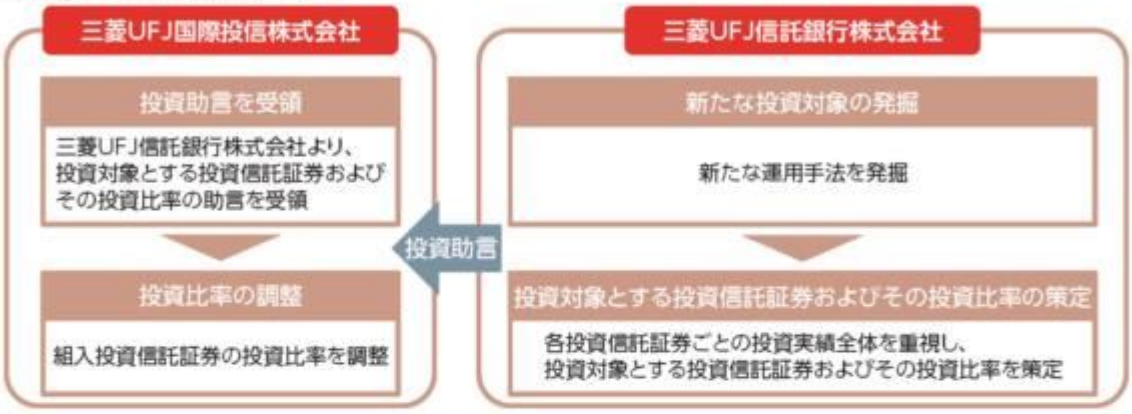
📖 ベンチマークとは、ファンドの運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指標です。

特色2 三菱UFJ信託銀行からの投資助言に基づき運用を行います。

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

- 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、投資環境の変化等に応じて適宜変更します。
- 投資助言者、投資助言の内容、投資助言の有無等については、変更する場合があります。

<運用プロセスのイメージ>



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

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

特色3 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。ただし、為替ヘッジにより、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。

為替ヘッジの活用

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

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

<投資リターンのイメージ図>

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

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

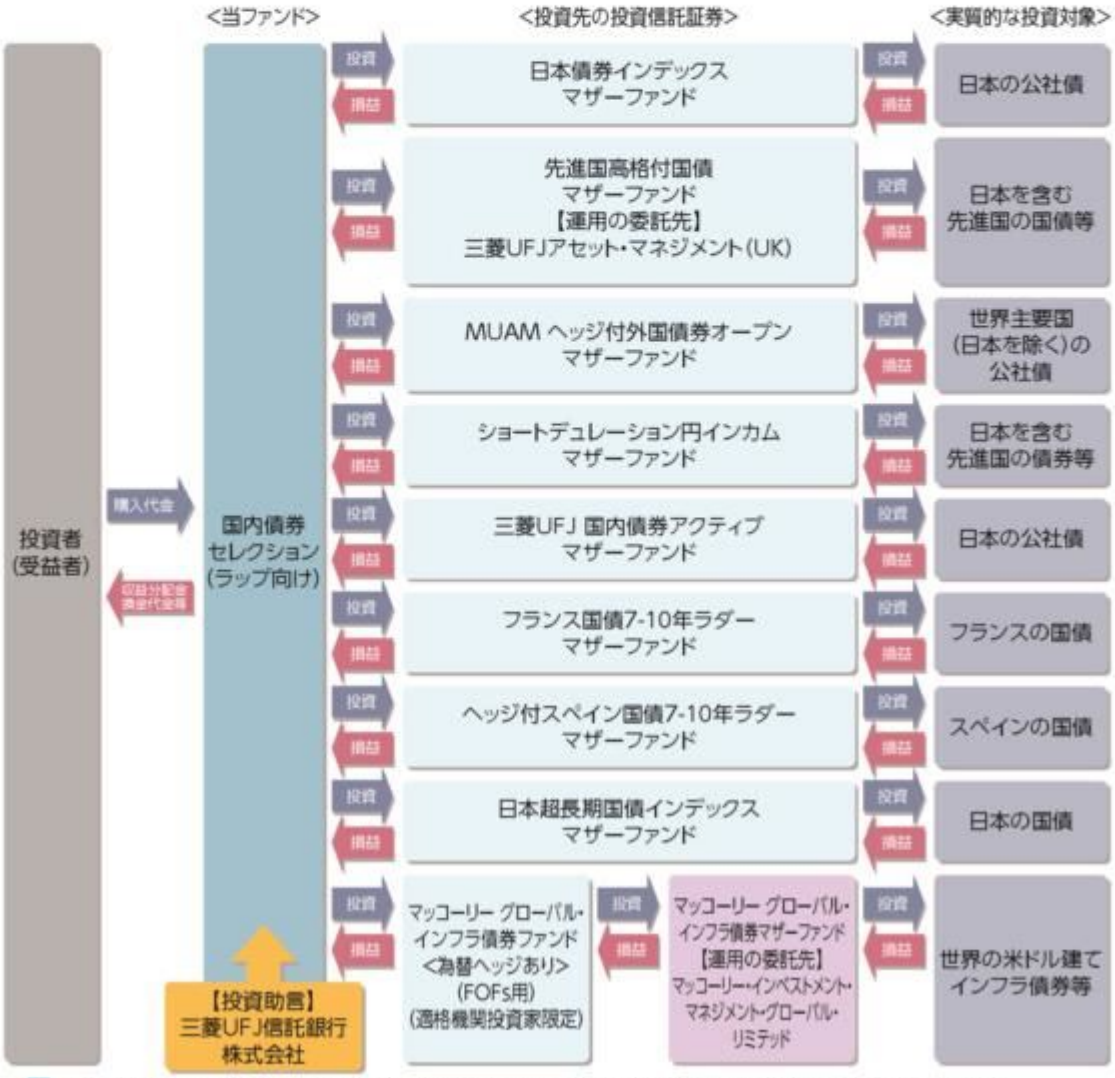
● 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ファンドの仕組み

ファンド・オブ・ファンズ方式により運用を行います。



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

■主な投資制限

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

■各投資信託証券の運用プロセス

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

ステップ1：投資対象ユニバースの作成

↓ ベンチマーク採用銘柄を主要投資対象とします。

ステップ2：ポートフォリオ案の作成

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

ステップ3：売買執行

↓ 売買執行の際には、売買コストの抑制に留意します。

ステップ4：モニタリング

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

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

<先進国高格付国債マザーファンド>

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

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

投資対象ユニバース

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

国別・残存期間別に魅力度を算出

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

ポートフォリオ構築

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

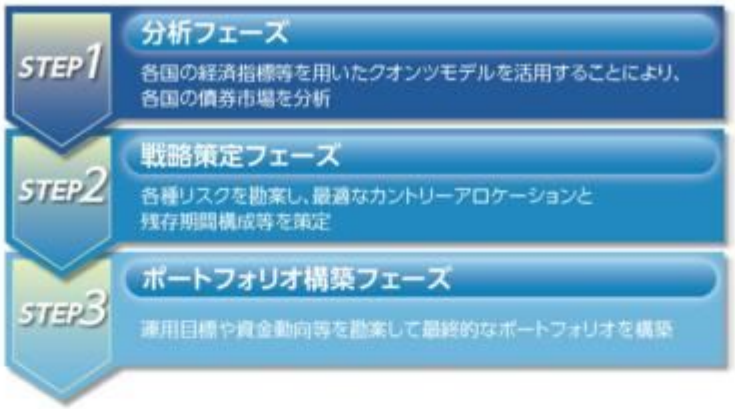
❗ 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

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

<MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド>

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

・運用にあたっては、クオンツモデルを活用します。



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

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

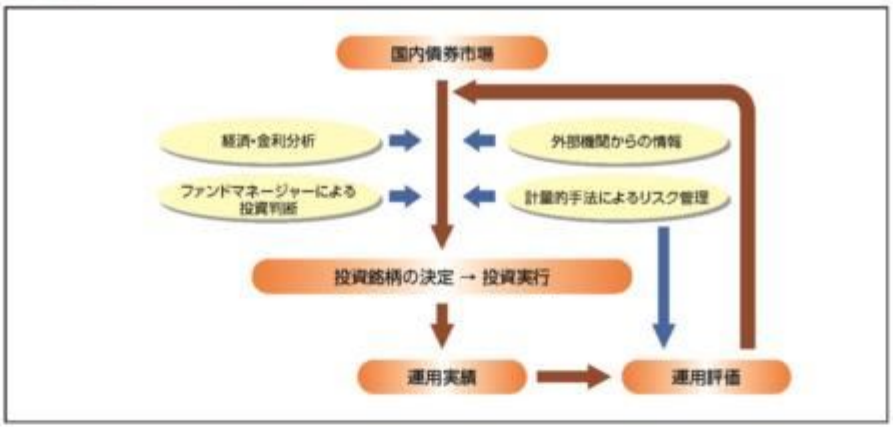
<ショートデュレーション円インカムマザーファンド>

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

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

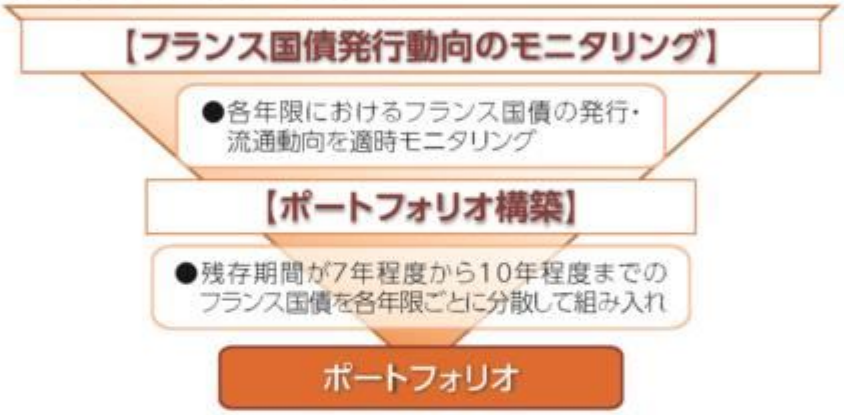
! 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、すべてを網羅するものではありません。また、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。上記のプロセスは、今後変更されることがあります。

<三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド>



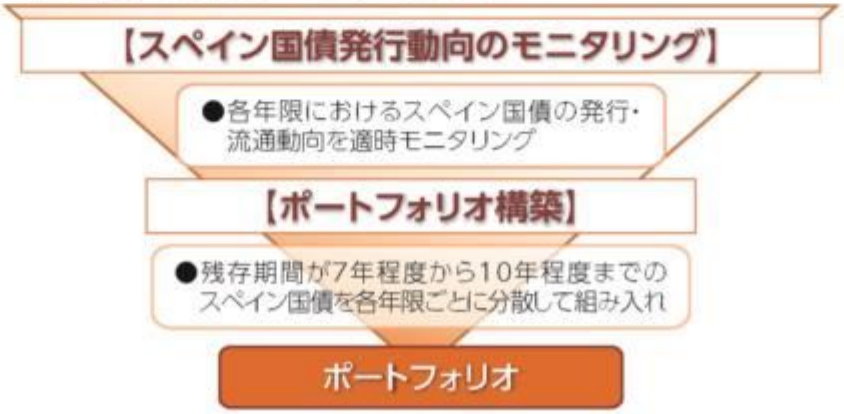
上記の運用プロセスは銘柄選定等の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄が常に上記の条件を満たすわけではありません。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。なお、今後、変更される場合があります。

<フランス国債7-10年ラダーマザーファンド>



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

<ヘッジ付スペイン国債7-10年ラダーマザーファンド>



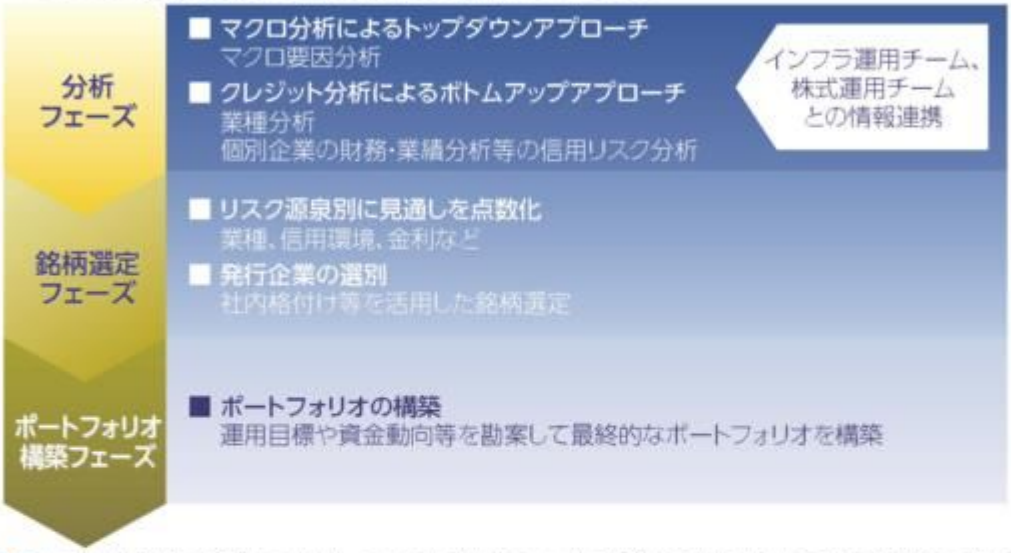
上記は銘柄選定の視点を示したものであり、すべてを網羅するものではありません。また、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。上記のプロセスは、今後変更されることがあります。

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

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

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

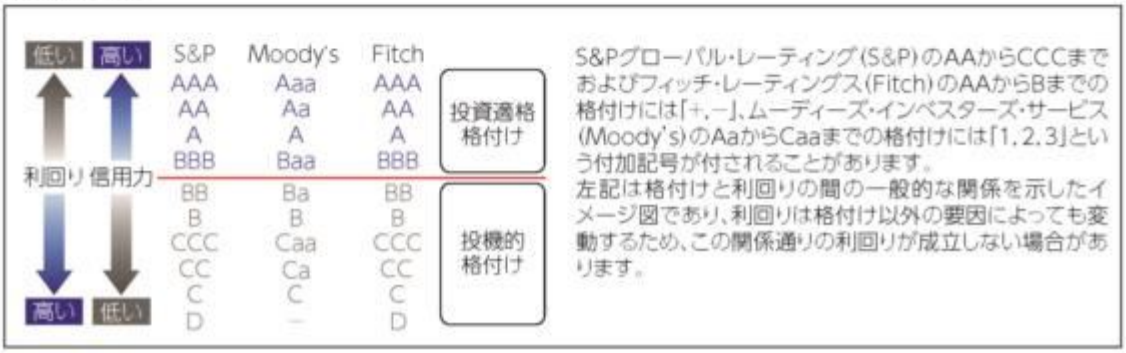
デュレーションとは、債券の投資元本の回収に要する平均残存期間や金利感応度を意味する指標です。この値が大きいほど、金利変動に対する債券価格の変動率が大きくなります。



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

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

<格付けとは>



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

指数について

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

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

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（２）【ファンドの沿革】

2017年3月13日　　設定日、信託契約締結、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】

①委託会社およびファンドの関係法人の役割

投資家（受益者）

お申込金↓↑収益分配金、解約代金等

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

お申込金↓↑収益分配金、解約代金等

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

投資↓↑損益

投資対象ファンド

投資↓↑損益

有価証券等

②委託会社と関係法人との契約の概要

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

③委託会社の概況（2022年2月末現在）

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

・設立年月日
1985年8月1日

・資本金
2,000百万円

・沿革

1997年5月	**東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始**
2004年10月	**東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更**
2005年10月	**三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ投信株式会社に変更**

2015年7月　　三菱ＵＦＪ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社に変更

・大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

投資信託証券を主要投資対象とします。
投資信託証券への投資を通じて、主として日本を含む世界の債券に実質的な投資を行います。
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社の助言に基づき、投資先ファンドの投資実績全体を重視し、ファンドを選定します。
投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。
投資信託証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。
実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（2）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類
この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）
　イ．有価証券
　ロ．約束手形
　ハ．金銭債権
２．次に掲げる特定資産以外の資産
　イ．為替手形

②有価証券の指図範囲
この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、別に定める投資信託証券（投資信託および外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）ならびに投資証券および外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）をいいます。以下同じ。）のほか、次に掲げるものとします。
１．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
２．コマーシャル・ペーパー
３．外国または外国の者の発行する証券または証書で、２．の証券の性質を有するもの
４．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
なお、１．の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は短期社債等への投資ならびに買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができます。

③金融商品の指図範囲
この信託において投資の対象とする金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）は、次に掲げるものとします。
１．預金
２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）
３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

④その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

・外国為替予約取引

＜投資信託証券の概要＞

ファンド名	日本債券インデックスマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主として対象インデックスに採用されている公社債に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。 ・投資成果を対象インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。 ・公社債の実質投資比率(組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。)は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。 ・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。 ・なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	NOMURA-BPI総合に採用されている公社債
主な投資制限	・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引を行うことができます。 ・デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2001年12月5日
決算日	原則として毎年5月12日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	先進国高格付国債マザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・日本を含む先進国の国債等に投資を行い、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。 ・投資する国債等(日本国債を除きます。)は、原則として取得時において最上位格付けを取得しているものに限ります。 ・銘柄選定にあたっては、最終利回り、イールドカーブおよび為替ヘッジコスト等を勘案して決定します。 ・組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。 ・債券等(為替ヘッジのために行う外国為替予約取引等を含みます。)の運用にあたっては、三菱UFJアセット・マネジメント(UK)に運用の指図に関する権限を委託します。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	日本を含む先進国の国債等
主な投資制限	・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ・有価証券先物取引等は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するためならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は為替変動リスクを回避するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社 (運用委託先:三菱UFJアセット・マネジメント(UK))
設定日	2012年12月20日
決算日	原則として毎年12月6日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・世界主要国の公社債(日本を除く)を主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)を中長期的に上回る投資成果を目指して運用を行います。 ・運用にあたっては、クオンツモデルを活用することにより主要国の各債券市場を分析し、債券の残存期間構成戦略を超過収益の源泉とします。また、為替変動リスクを回避するため、原則としてフルヘッジを行います。 ・株式への投資は、転換社債および転換社債型新株予約権付社債の転換等により取得したものに限ります。 ・なお、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。 ・また、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引ならびに金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
主な投資対象	世界主要国の公社債(日本を除く)
主な投資制限	・株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2000年7月19日
決算日	原則として毎年6月15日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	ショートデュレーション円インカムマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主として日本を含む先進国の債券等に投資を行います。 ・債券等への投資にあたっては、信用リスクおよび金利変動リスクに配慮しながら銘柄選定を行います。 組入債券等は、原則として取得時においてBBB−格相当以上の格付を有しているものに限ります。 ・ポートフォリオのデュレーションは、原則として0～3年程度とします。 ・デュレーション調整等のため、先物取引等を利用する場合があります。 ・債券等の組入比率は市況動向等に基づき変動します。 ・組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	日本を含む先進国の債券等
主な投資制限	・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は為替変動リスクを回避するため行うことができます。
運用管理費用 （信託報酬）	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2017年7月24日
決算日	原則として毎年2月20日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

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

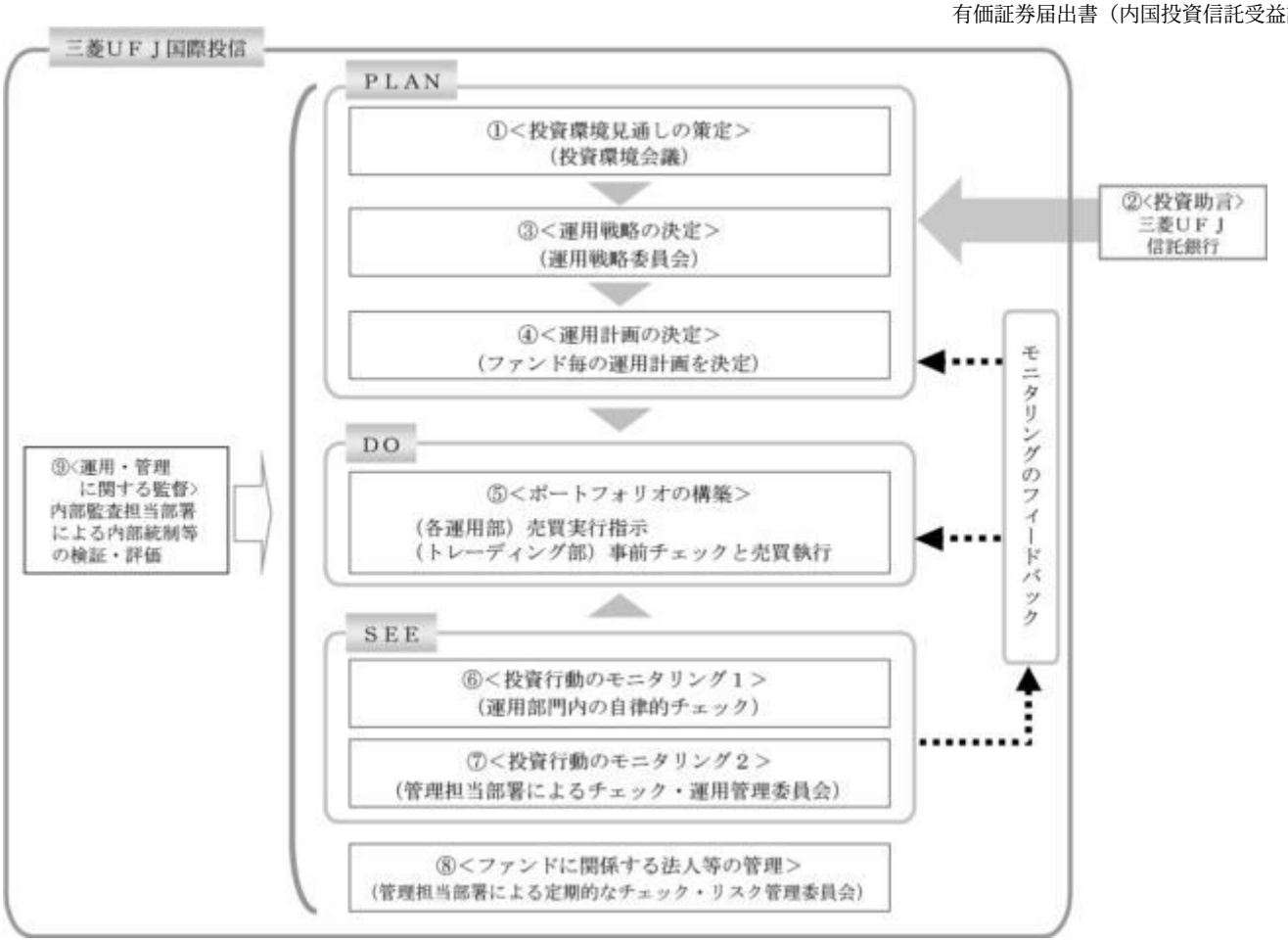
ファンド名	フランス国債7-10年ラダーマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主としてフランスの国債に投資を行います。 ・原則として、残存期間が7年程度から10年程度までのフランス国債に投資し、各残存期間ごとの投資金額が同額程度になるような運用をめざします。 ・組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	フランスの国債
主な投資制限	・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ・有価証券先物取引等は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・スワップ取引は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は為替変動リスクを回避するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2017年6月12日
決算日	原則として毎年3月17日、9月17日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	ヘッジ付スペイン国債7-10年ラダーマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主としてスペインの国債に投資を行います。 ・原則として、残存期間が7年程度から10年程度までのスペイン国債に投資し、各残存期間ごとの投資金額が同額程度になるような運用をめざします。 ・組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	スペインの国債
主な投資制限	・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ・有価証券先物取引等は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・スワップ取引は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
運用管理費用 （信託報酬）	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2019年4月24日
決算日	原則として毎年3月17日、9月17日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	日本超長期国債インデックスマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主としてわが国の国債に投資を行います。 ・国債の組入比率は高位を維持することを基本とします。 ・対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し債券の実質投資比率が100%を超える場合があります。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の国債
主な投資制限	・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
運用管理費用 （信託報酬）	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2016年4月11日
決算日	原則として毎年5月12日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>(FOFs用)(適格機関投資家限定)
形態	証券投資信託
投資態度	・マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券に実質的な投資を行います。なお、インフラ関連企業とは、公益、通信、エネルギーおよび運輸等の日常生活に必要不可欠なサービスを提供する企業をいいます。 ・マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。 ・実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
マザーファンドの投資態度	・世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。なお、インフラ関連企業とは、公益、通信、エネルギーおよび運輸等の日常生活に必要不可欠なサービスを提供する企業をいいます。 ・債券への投資にあたっては、マクロ要因分析、業種分析、個別企業の財務・業務分析等の信用リスク分析に基づき、銘柄選定を行います。 ・組入公社債の格付けは、原則として取得時においてBBB－格相当以上の格付を有しているものに限ります。 ・デュレーション調整等のため、債券先物取引等を利用する場合があります。また、ファンドの流動性等を勘案して、一部、米国国債等に投資する場合があります。 ・債券等の運用にあたっては、マッコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。 ・組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド受益証券
主な投資制限	・株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10％以下とします。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10％以下とします。 ・投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5％以下とします。 ・同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5％以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5％以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10％以下とします。 ・外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
運用管理費用(信託報酬)	純資産総額の年0.3696％(税込)
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社 (マザーファンドの運用委託先:マッコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・リミテッド)
設定日	2015年2月20日
決算日	原則として毎年5月10日、11月10日
分配方針	毎計算期末に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 ②収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 ③収益の分配にあてなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

（３）【運用体制】



①投資環境見通しの策定
投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。
②投資助言
当ファンドは、三菱ＵＦＪ信託銀行（「助言元」といいます。）から運用戦略または運用計画の立案に資する投資助言を受けています。
③運用戦略の決定
運用戦略委員会において、①で策定された投資環境見通し、および②の投資助言に沿って運用戦略を決定します。
④運用計画の決定
③で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。
⑤ポートフォリオの構築
各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。
⑥投資行動のモニタリング１
運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。
⑦投資行動のモニタリング２
運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。
⑧ファンドに関係する法人等の管理
助言元、受託会社等、ファンドの運営に関係する法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。
⑨運用・管理に関する監督
内部監査担当部署（10名程度）は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。
なお、委託会社に関する「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページでご覧いただけます。
「運用担当者に係る事項」　https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html

（4）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。
①分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
②収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。
③収益の分配にあてなかった利益については、信託約款に定める運用の基本方針に基づいて運用を行います。

（5）【投資制限】

＜信託約款に定められた投資制限＞
①株式
株式への直接投資は行いません。
②投資信託証券
投資信託証券への投資割合に制限を設けません。
③信用取引
信用取引の指図は行いません。
④外国為替予約取引
委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
⑤公社債の借入れ
ａ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
ｂ．ａ．の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
ｃ．信託財産の一部解約等の事由により、ｂ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
⑥資金の借入れ
ａ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
ｂ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
ｃ．収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
⑦特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

⑧信用リスクの分散規制

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

3【投資リスク】

（1）投資リスク

ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けますが、これらの運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。
したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
投資信託は預貯金と異なります。
ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。
（主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。）

価格変動リスク	一般に、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動するため、ファンドはその影響を受け組入公社債の価格の下落は基準価額の下落要因となります。
為替変動リスク	組入外貨建資産については、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図りますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。為替ヘッジを行う場合で円金利がヘッジ対象通貨建の金利より低いときには、これらの金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。
信用リスク	組入有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等には、当該組入有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払い・償還金の支払いが滞ることがあります。
流動性リスク	有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合または取引が不可能となる場合、市場実勢から期待される価格より不利な価格での取引となる可能性があります。

※留意事項

・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の６の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
・当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付けが中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。
投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。

（２）投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行い、運用管理委員会において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。
また、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策を策定し流動性リスクの評価と管理プロセスの検証などを行います。運用管理委員会は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。
具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

①トレーディング担当部署
有価証券等の売買執行および発注に係る法令等の遵守および監視・牽制を行います。

②コンプライアンス担当部署
法令上の禁止行為、約款の投資制限等のモニタリングを通じ、法令等遵守状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

③リスク管理担当部署
運用リスク全般の状況をモニタリング・管理するとともに、運用実績の分析および評価を行い、必要に応じて改善策等を提言します。また、事務・情報資産・その他のリスクの統括的管理を行っています。

④内部監査担当部署
委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

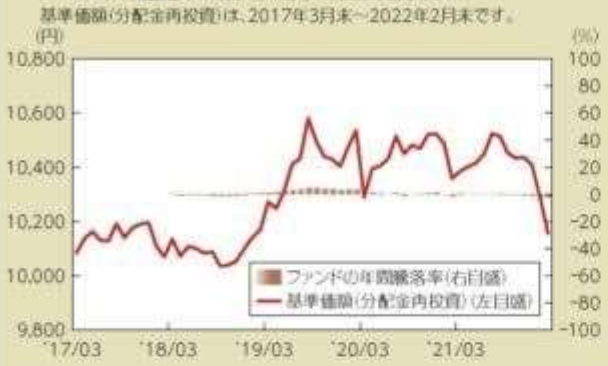
＊組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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

● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

ファンドの年間騰落率は、2018年3月～2022年2月です。
基準価額(分配金再投資)は、2017年3月末～2022年2月末です。



● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2017年3月末～2022年2月末)
ファンドの年間騰落率は、2018年3月～2022年2月です。

(注)全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

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

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

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

（２）【換金（解約）手数料】

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

（３）【信託報酬等】

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

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

・信託報酬は、毎計算期間の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

・信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

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

※上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

受益者が負担する実質的な信託報酬率（概算値）は、次の通りとなります。

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

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

（注）上記概算値は、投資対象とする投資信託証券における信託報酬率を含めた実質的な信託報酬率を算出したものです（2022年５月７日現在）。各投資信託証券への投資比率が変動する可能性や投資信託証券の変更の可能性があること、また別途成功報酬がかかる投資信託証券が含まれる場合があることから、実質的な信託報酬率は変動します。したがって事前に固定の料率、上限額等を表示することはできません。

＜投資信託証券の信託報酬率＞

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

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

※上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかる場合があります。

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

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

１．収益分配金の課税

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

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

２．解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

②法人の受益者に対する課税

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

度の適用はありません。
買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

◇個別元本について
①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。
③受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

◇収益分配金について
受益者が収益分配金を受け取る際、①当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

※上記は2022年2月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【国内債券セレクション（ラップ向け）】

（1）【投資状況】

令和 4年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（%）
投資信託受益証券	日本	5,055,978,257	13.26
親投資信託受益証券	日本	32,239,082,756	84.55
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	834,205,392	2.19
純資産総額		38,129,266,405	100.00

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

（2）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

ａ評価額上位３０銘柄

令和 4年 2月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ショートデュレーション円インカムマザーファンド	8,949,733,665	0.9615	8,605,168,918	0.9592	8,584,584,531	22.51
日本	親投資信託受益証券	三菱ＵＦＪ　国内債券アクティブマザーファンド	5,188,072,252	1.4527	7,536,712,560	1.4507	7,526,336,415	19.74
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	4,248,122,089	1.3312	5,655,100,124	1.3294	5,647,453,505	14.81
日本	親投資信託受益証券	日本超長期国債インデックスマザーファンド	5,668,009,280	0.9879	5,599,426,367	0.9833	5,573,353,525	14.62
日本	投資信託受益証券	ＡＭＰ グローバル・インフラ債券ファンド＜為替ヘッジあり＞（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	4,640,640,897	1.116	5,178,955,241	1.0895	5,055,978,257	13.26
日本	親投資信託受益証券	ＭＵＡＭ　ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド	1,602,673,106	1.6892	2,707,235,410	1.6754	2,685,118,521	7.04
日本	親投資信託受益証券	先進国高格付国債マザーファンド	685,139,559	1.1063	757,969,894	1.0939	749,474,163	1.97
日本	親投資信託受益証券	フランス国債７－１０年ラダーマザーファンド	680,929,557	1.0880	740,851,358	1.0854	739,080,941	1.94
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付スペイン国債７－１０年ラダーマザーファンド	709,556,243	1.0392	737,370,847	1.0340	733,681,155	1.92

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

ｂ全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 4年 2月28日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	13.26
親投資信託受益証券	84.55
合計	97.81

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和4年2月末日、同日前１年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

	純資産総額		基準価額（1万口当たりの純資産価額）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間末日　(平成30年 2月 5日)	11,105,960,848	11,105,960,848	10,075	10,075
第2計算期間末日　(平成31年 2月 5日)	16,779,646,867	16,779,646,867	10,153	10,153
第3計算期間末日　(令和 2年 2月 5日)	19,288,687,531	19,288,687,531	10,452	10,452
第4計算期間末日　(令和 3年 2月 5日)	24,115,146,293	24,115,146,293	10,473	10,473
第5計算期間末日　(令和 4年 2月 7日)	38,319,603,528	38,319,603,528	10,219	10,219
令和 3年 2月末日	24,244,203,634	—	10,358	—
3月末日	25,443,329,610	—	10,385	—
4月末日	26,751,243,728	—	10,402	—
5月末日	28,966,141,412	—	10,416	—
6月末日	30,872,839,456	—	10,448	—
7月末日	32,656,247,650	—	10,524	—
8月末日	34,053,338,617	—	10,514	—
9月末日	34,702,982,270	—	10,452	—
10月末日	35,347,258,846	—	10,434	—
11月末日	36,438,161,843	—	10,437	—
12月末日	37,523,023,783	—	10,410	—
令和 4年 1月末日	38,598,054,420	—	10,292	—
2月末日	38,129,266,405	—	10,157	—

②【分配の推移】

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

③【収益率の推移】

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

第5計算期間	△2.42

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	12,571,701,220	1,548,474,323	11,023,226,897
第2計算期間	8,904,288,458	3,400,559,093	16,526,956,262
第3計算期間	5,442,609,493	3,515,542,243	18,454,023,512
第4計算期間	11,312,543,909	6,741,276,409	23,025,291,012
第5計算期間	19,050,884,403	4,578,823,747	37,497,351,668

（参考）

日本債券インデックスマザーファンド

投資状況

令和 4年 2月28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	543,659,537,170	83.14
地方債証券	日本	36,319,105,623	5.55
特殊債券	日本	33,156,844,429	5.07
社債券	日本	36,935,018,000	5.65
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	3,801,200,772	0.59
純資産総額		653,871,705,994	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 4年 2月28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	752,500,000	0.12

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

ａ評価額上位３０銘柄

令和 4年 2月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限(年/月/日)	投資比率(%)
日本	国債証券	第１４９回利付国債（５年）	9,180,000,000	100.38	9,215,662,500	100.02	9,182,019,600	0.005000	2026/9/20	1.40
日本	国債証券	第３６３回利付国債（１０年）	9,150,000,000	100.57	9,202,350,500	99.54	9,108,001,500	0.100000	2031/6/20	1.39
日本	国債証券	第３５９回利付国債（１０年）	7,380,000,000	100.71	7,432,846,000	100.00	7,380,000,000	0.100000	2030/6/20	1.13
日本	国債証券	第３６４回利付国債（１０年）	7,180,000,000	100.33	7,204,356,400	99.38	7,136,058,400	0.100000	2031/9/20	1.09
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	6,920,000,000	101.14	6,999,225,800	100.42	6,949,202,400	0.100000	2028/3/20	1.06
日本	国債証券	第３６０回利付国債（１０年）	6,720,000,000	100.71	6,768,222,100	99.91	6,714,288,000	0.100000	2030/9/20	1.03
日本	国債証券	第３４５回利付国債（１０年）	6,340,000,000	101.01	6,404,451,100	100.45	6,368,910,400	0.100000	2026/12/20	0.97
日本	国債証券	第１４６回利付国債（５年）	6,260,000,000	100.89	6,315,714,000	100.41	6,286,166,800	0.100000	2025/12/20	0.96
日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	6,250,000,000	100.57	6,285,636,200	100.26	6,266,375,000	0.100000	2023/12/20	0.96
日本	国債証券	第３５６回利付国債（１０年）	6,230,000,000	101.04	6,295,216,500	100.22	6,244,017,500	0.100000	2029/9/20	0.95
日本	国債証券	第３５８回利付国債（１０年）	6,130,000,000	100.88	6,184,219,200	100.11	6,137,294,700	0.100000	2030/3/20	0.94
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	5,930,000,000	101.02	5,990,950,400	100.45	5,956,922,200	0.100000	2027/3/20	0.91
日本	国債証券	第３４９回利付国債（１０年）	5,750,000,000	101.16	5,817,254,000	100.43	5,774,955,000	0.100000	2027/12/20	0.88
日本	国債証券	第３４８回利付国債（１０年）	5,390,000,000	100.99	5,443,669,600	100.44	5,413,877,700	0.100000	2027/9/20	0.83
日本	国債証券	第１４４回利付国債（５年）	5,330,000,000	100.84	5,374,772,000	100.38	5,350,254,000	0.100000	2025/6/20	0.82
日本	国債証券	第３４７回利付国債（１０年）	5,250,000,000	101.07	5,306,319,000	100.45	5,273,625,000	0.100000	2027/6/20	0.81
日本	国債証券	第３６２回利付国債（１０年）	5,210,000,000	100.50	5,236,293,500	99.68	5,193,692,700	0.100000	2031/3/20	0.79
日本	国債証券	第１４３回利付国債（５年）	5,060,000,000	100.76	5,098,861,000	100.35	5,077,760,600	0.100000	2025/3/20	0.78
日本	国債証券	第３４３回利付国債（１０年）	4,870,000,000	100.95	4,916,645,300	100.45	4,892,012,400	0.100000	2026/6/20	0.75
日本	国債証券	第４２７回利付国債（２年）	4,860,000,000	100.23	4,871,561,500	100.09	4,864,471,200	0.005000	2023/8/1	0.74
日本	国債証券	第１４０回利付国債（５年）	4,840,000,000	100.60	4,869,223,300	100.29	4,854,471,600	0.100000	2024/6/20	0.74
日本	国債証券	第３２９回利付国債（１０年）	4,690,000,000	101.80	4,774,699,100	101.12	4,742,621,800	0.800000	2023/6/20	0.73
日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	4,620,000,000	100.99	4,666,076,000	100.45	4,641,021,000	0.100000	2026/9/20	0.71
日本	国債証券	第３５５回利付国債（１０年）	4,600,000,000	101.09	4,650,140,000	100.29	4,613,340,000	0.100000	2029/6/20	0.71
日本	国債証券	第４２６回利付国債（２年）	4,530,000,000	100.20	4,539,346,500	100.08	4,533,895,800	0.005000	2023/7/1	0.69
日本	国債証券	第１４５回利付国債（５年）	4,490,000,000	100.87	4,529,382,400	100.39	4,507,555,900	0.100000	2025/9/20	0.69

日本	国債証券	第３５７回利付国債（１０年）	4,480,000,000	101.01	4,525,272,400	100.15	4,486,944,000	0.100000	2029/12/20	0.69
日本	国債証券	第４２３回利付国債（２年）	4,300,000,000	100.22	4,309,719,500	100.07	4,303,225,000	0.005000	2023/4/1	0.66
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	4,230,000,000	101.15	4,278,933,000	100.40	4,247,216,100	0.100000	2028/12/20	0.65
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	4,150,000,000	100.97	4,190,624,500	100.39	4,166,268,000	0.100000	2028/9/20	0.64

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

ｂ全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 4年 2月28日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	83.14
地方債証券	5.55
特殊債券	5.07
社債券	5.65
合計	99.42

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

令和 4年 2月28日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物２２年０３月限	買建	5	円	759,905,500	752,500,000	0.12

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

先進国高格付国債マザーファンド

投資状況

令和 4年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（%）
国債証券	オーストラリア	54,279,973,707	57.15
	シンガポール	37,105,806,306	39.06
	小計	91,385,780,013	96.21
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	—	3,599,951,674	3.79
純資産総額		94,985,731,687	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

ａ評価額上位３０銘柄

令和 4年 2月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限(年/月/日)	投資比率(%)
シンガポール	国債証券	2.875 SINGAPORGOV 290701	142,000,000	9,280.02	13,177,630,956	9,100.01	12,922,025,134	2.875000	2029/7/1	13.60
オーストラリア	国債証券	4.75 AUST GOVT 270421	117,000,000	9,760.72	11,420,050,005	9,425.92	11,028,334,623	4.750000	2027/4/21	11.61
シンガポール	国債証券	2.625 SINGAPORGOV 280501	111,000,000	9,104.48	10,105,976,158	8,923.42	9,905,002,860	2.625000	2028/5/1	10.43
オーストラリア	国債証券	0.5 AUST GOVT 260921	120,000,000	7,995.48	9,594,580,221	7,784.61	9,341,537,447	0.500000	2026/9/21	9.83
オーストラリア	国債証券	2.5 AUST GOVT 300521	109,200,000	8,925.28	9,746,410,992	8,505.50	9,288,008,419	2.500000	2030/5/21	9.78
オーストラリア	国債証券	0.25 AUST GOVT 251121	115,000,000	7,993.96	9,193,057,479	7,832.67	9,007,574,941	0.250000	2025/11/21	9.48
オーストラリア	国債証券	3.25 AUST GOVT 290421	97,000,000	9,319.43	9,039,849,525	8,921.11	8,653,479,839	3.250000	2029/4/21	9.11
シンガポール	国債証券	3.5 SINGAPORGOVT 270301	93,000,000	9,413.95	8,754,981,405	9,240.77	8,593,924,656	3.500000	2027/3/1	9.05
オーストラリア	国債証券	2.25 AUST GOVT 280521	83,000,000	8,715.25	7,233,665,417	8,386.79	6,961,038,438	2.250000	2028/5/21	7.33
シンガポール	国債証券	2.875SINGAPORGOVT 300901	62,000,000	9,327.15	5,782,836,457	9,169.11	5,684,853,656	2.875000	2030/9/1	5.98

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

ｂ全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 4年 2月28日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	96.21
合計	96.21

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ＭＵＡＭ　ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド

投資状況

令和 4年 2月28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	63,748,955,736	43.94
	フランス	14,051,972,087	9.69
	イタリア	13,753,122,913	9.48
	ドイツ	10,465,358,387	7.21
	オーストラリア	9,707,081,500	6.69
	イギリス	9,166,269,947	6.32
	スペイン	9,144,742,114	6.30
	オーストリア	3,114,458,441	2.15
	オランダ	2,922,753,582	2.01
	ベルギー	2,667,689,170	1.84
	アイルランド	1,809,467,975	1.25
	中国	1,333,603,962	0.92
	フィンランド	795,889,284	0.55
	ポーランド	677,073,904	0.47
	小計	143,358,439,002	98.81
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	—	1,723,604,220	1.19
純資産総額		145,082,043,222	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

ａ評価額上位３０銘柄

令和 4年 2月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限(年/月/日)	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	1.375 T-BOND 401115	113,900,000	10,388.20	11,832,165,627	9,781.12	11,140,703,597	1.375000	2040/11/15	7.68
アメリカ	国債証券	0.25 T-NOTE 250731	63,600,000	11,309.18	7,192,642,583	10,950.61	6,964,593,893	0.250000	2025/7/31	4.80
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 280331	61,400,000	11,603.53	7,124,568,034	11,092.34	6,810,702,057	1.250000	2028/3/31	4.69
アメリカ	国債証券	0.375 T-NOTE 240915	46,800,000	11,516.18	5,389,573,374	11,171.33	5,228,186,133	0.375000	2024/9/15	3.60

アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300515	47,600,000	10,780.97	5,131,746,170	10,380.54	4,941,138,264	0.625000	2030/5/15	3.41
イギリス	国債証券	1.25 GILT 411022	32,600,000	15,646.59	5,100,789,722	14,319.79	4,668,253,673	1.250000	2041/10/22	3.22
アメリカ	国債証券	0.125 T-NOTE 230831	39,400,000	11,505.03	4,532,985,227	11,332.92	4,465,173,374	0.125000	2023/8/31	3.08
アメリカ	国債証券	0.75 T-NOTE 260831	40,000,000	11,328.62	4,531,450,904	10,987.63	4,395,052,575	0.750000	2026/8/31	3.03
フランス	国債証券	0.5 O.A.T 400525	35,350,000	12,845.91	4,541,031,041	11,880.00	4,199,582,948	0.500000	2040/5/25	2.89
アメリカ	国債証券	1.25 T-BOND 500515	44,600,000	9,581.73	4,273,455,412	8,956.93	3,994,790,989	1.250000	2050/5/15	2.75
オーストラリア	国債証券	2.5 AUST GOVT 300521	44,900,000	8,855.22	3,975,993,906	8,505.50	3,818,970,494	2.500000	2030/5/21	2.63
イタリア	国債証券	3.1 ITALY GOVT 400301	23,330,000	16,376.31	3,820,593,945	14,743.19	3,439,587,389	3.100000	2040/3/1	2.37
アメリカ	国債証券	0.25 T-NOTE 230615	27,400,000	11,574.64	3,171,452,319	11,393.41	3,121,794,489	0.250000	2023/6/15	2.15
アメリカ	国債証券	0.125 T-NOTE 231215	26,400,000	11,527.26	3,043,198,751	11,267.47	2,974,614,480	0.125000	2023/12/15	2.05
オーストラリア	国債証券	2.25 AUST GOVT 280521	35,200,000	8,578.52	3,019,640,131	8,386.79	2,952,151,241	2.250000	2028/5/21	2.03
オーストラリア	国債証券	1 AUST GOVT 311121	39,600,000	7,662.34	3,034,286,779	7,414.03	2,935,959,765	1.000000	2031/11/21	2.02
スペイン	国債証券	1.2 SPAIN GOVT 401031	22,930,000	13,186.74	3,023,721,385	12,053.55	2,763,879,080	1.200000	2040/10/31	1.91
アメリカ	国債証券	0.5 T-NOTE 270531	23,100,000	11,216.83	2,591,089,626	10,751.56	2,483,611,840	0.500000	2027/5/31	1.71
ドイツ	国債証券	0 BUND 360515	18,690,000	13,142.30	2,456,297,491	12,295.13	2,297,961,292	0.000000	2036/5/15	1.58
ドイツ	国債証券	0 BUND 271115	16,050,000	13,340.12	2,141,090,480	12,928.07	2,074,956,235	0.000000	2027/11/15	1.43
ドイツ	国債証券	0 BUND 310215	16,250,000	13,256.05	2,154,109,198	12,761.68	2,073,773,052	0.000000	2031/2/15	1.43
イタリア	国債証券	0.6 ITALY GOVT 230615	14,850,000	13,191.38	1,958,920,910	13,090.82	1,943,987,475	0.600000	2023/6/15	1.34
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 250131	16,900,000	11,921.29	2,014,698,602	11,427.71	1,931,283,742	1.375000	2025/1/31	1.33
フランス	国債証券	4.5 O.A.T 410425	9,160,000	22,439.22	2,055,433,280	20,916.11	1,915,916,100	4.500000	2041/4/25	1.32
アメリカ	国債証券	2 T-BOND 411115	17,600,000	11,368.96	2,000,937,752	10,835.06	1,906,972,202	2.000000	2041/11/15	1.31
フランス	国債証券	0 O.A.T 260225	14,280,000	13,212.53	1,886,750,354	12,901.10	1,842,278,342	0.000000	2026/2/25	1.27
イタリア	国債証券	2.8 ITALY GOVT 281201	12,200,000	15,184.51	1,852,510,952	14,184.43	1,730,500,857	2.800000	2028/12/1	1.19
イタリア	国債証券	0.25 ITALY GOVT 280315	14,140,000	12,798.83	1,809,755,287	12,190.89	1,723,792,846	0.250000	2028/3/15	1.19
スペイン	国債証券	1.3 SPAIN GOVT 261031	11,960,000	13,944.65	1,667,781,097	13,445.29	1,608,057,157	1.300000	2026/10/31	1.11
フランス	国債証券	1.75 O.A.T 230525	11,990,000	13,523.79	1,621,502,469	13,305.46	1,595,325,191	1.750000	2023/5/25	1.10

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 4年 2月28日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.81
合計	98.81

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ショートデュレーション円インカムマザーファンド

投資状況

令和 4年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（%）
国債証券	日本	1,590,756,870	17.61
	フランス	226,192,896	2.50
	イタリア	116,566,667	1.29
	アメリカ	114,841,352	1.27
	小計	2,048,357,785	22.68
特殊債券	カナダ	410,688,606	4.55
	ドイツ	322,160,395	3.57
	オーストラリア	218,727,163	2.42
	アメリカ	135,459,491	1.50
	小計	1,087,035,655	12.03
社債券	オーストラリア	1,356,190,777	15.01
	アメリカ	701,459,640	7.77
	イギリス	408,366,241	4.52
	スウェーデン	346,261,839	3.83
	オランダ	273,129,696	3.02
	カナダ	181,356,729	2.01
	フランス	130,031,969	1.44
	ドイツ	126,122,797	1.40
	日本	101,345,000	1.12
	小計	3,624,264,688	40.12
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	—	2,272,829,363	25.17
純資産総額		9,032,487,491	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 4年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（%）

債券先物取引	売建	アメリカ	457,449,825	△5.06
	売建	カナダ	159,839,310	△1.77
	売建	ドイツ	813,121,778	△9.00
	売建	オーストラリア	155,055,881	△1.72

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

ａ評価額上位３０銘柄

令和 4年 2月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限(年/月/日)	投資比率(%)
日本	国債証券	第４３１回利付国債（２年）	400,000,000	100.07	400,280,000	100.08	400,348,000	0.005000	2023/12/1	4.43
日本	国債証券	第１０５９回国庫短期証券	350,000,000	100.06	350,240,100	100.07	350,259,350	—	2023/2/20	3.88
日本	国債証券	第１０４３回国庫短期証券	340,000,000	100.02	340,080,240	100.02	340,082,620	—	2022/6/10	3.77
日本	国債証券	第１０３２回国庫短期証券	300,000,000	100.01	300,045,300	100.01	300,042,300	—	2022/4/25	3.32
オーストラリア	社債券	3.25 COMMONWEALT 261117	3,000,000	8,542.32	256,269,712	8,549.23	256,477,004	3.250000	2026/11/17	2.84
オーストラリア	社債券	3.85 GENERAL MOTO 230221	3,000,000	8,494.60	254,838,003	8,489.63	254,688,967	3.850000	2023/2/21	2.82
フランス	国債証券	1.75 O.A.T 230525	1,700,000	13,314.03	226,338,675	13,305.46	226,192,896	1.750000	2023/5/25	2.50
オーストラリア	社債券	3.45 AT&T INC 230919	2,500,000	8,526.97	213,174,325	8,522.56	213,064,188	3.450000	2023/9/19	2.36
日本	国債証券	第１０５１回国庫短期証券	200,000,000	100.01	200,026,800	100.01	200,024,600	—	2022/4/18	2.21
ドイツ	特殊債券	0.375 LB BADEN-WU 260729	1,500,000	12,622.96	189,344,447	12,541.47	188,122,184	0.375000	2026/7/29	2.08
スウェーデン	社債券	1.25 SWEDISH COVE 220615	15,000,000	1,215.36	182,304,064	1,214.98	182,247,272	1.250000	2022/6/15	2.02
カナダ	特殊債券	1.9 IBRD 250116	2,000,000	9,055.53	181,110,605	9,039.80	180,796,139	1.900000	2025/1/16	2.00
オーストラリア	社債券	FRN NATIONAL A 230316	2,000,000	8,336.39	166,727,957	8,334.67	166,693,450	0.715000	2023/3/16	1.85
スウェーデン	社債券	0.5 STADSHYPOTEK 260601	14,000,000	1,178.91	165,048,669	1,171.53	164,014,567	0.500000	2026/6/1	1.82
アメリカ	社債券	STEP BRITISH TEL 301215	1,000,000	16,178.41	161,784,150	16,074.89	160,748,951	9.625000	2030/12/15	1.78
イギリス	社債券	2.125 BAT CAPITAL 250815	1,000,000	15,000.45	150,004,586	14,966.57	149,665,754	2.125000	2025/8/15	1.66
オランダ	社債券	4.5 STELLANTIS NV 280707	1,000,000	15,042.92	150,429,275	14,944.31	149,443,148	4.500000	2028/7/7	1.65
オーストラリア	社債券	3 ING BANK (AUSTR 230907	1,700,000	8,500.03	144,500,552	8,496.60	144,442,355	3.000000	2023/9/7	1.60
イギリス	社債券	2.519 BP CAPITAL 280407	1,000,000	13,915.62	139,156,259	13,778.91	137,789,187	2.519000	2028/4/7	1.53
アメリカ	特殊債券	1.75 ASIAN DEV 290919	1,200,000	11,356.66	136,279,940	11,288.29	135,459,491	1.750000	2029/9/19	1.50
ドイツ	特殊債券	1.5 KFW 240611	1,000,000	13,410.21	134,102,170	13,403.82	134,038,211	1.500000	2024/6/11	1.48

オーストラリア	特殊債券	4 KFW 250227	1,500,000	8,786.49	131,797,455	8,793.03	131,895,452	4.000000	2025/2/27	1.46
カナダ	特殊債券	1.5 ASIAN DEV 280504	1,500,000	8,695.45	130,431,898	8,674.91	130,123,677	1.500000	2028/5/4	1.44
フランス	社債券	0.75 LVMH MOET HE 250407	1,000,000	13,060.70	130,607,015	13,003.19	130,031,969	0.750000	2025/4/7	1.44
ドイツ	社債券	0.75 BAYER AG 270106	1,000,000	12,741.45	127,414,515	12,612.27	126,122,797	0.750000	2027/1/6	1.40
アメリカ	社債券	0.524 EXXON MOBIL 280626	1,000,000	12,563.73	125,637,384	12,440.47	124,404,774	0.524000	2028/6/26	1.38
オランダ	社債券	0.625 STELLANTIS 270330	1,000,000	12,452.20	124,522,016	12,368.65	123,686,548	0.625000	2027/3/30	1.37
アメリカ	社債券	4.75 VIACOMCBS IN 250515	1,000,000	12,340.78	123,407,891	12,280.96	122,809,607	4.750000	2025/5/15	1.36
オーストラリア	社債券	1.125 VICINITY CE 291107	1,000,000	12,349.09	123,490,987	12,142.24	121,422,452	1.125000	2029/11/7	1.34
イギリス	社債券	0.163 NATIONAL GR 280120	1,000,000	12,210.82	122,108,212	12,091.13	120,911,300	0.163000	2028/1/20	1.34

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

ｂ全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 4年 2月28日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	22.68
特殊債券	12.03
社債券	40.12
合計	74.84

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

令和 4年 2月28日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（%）
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	NOTE5Y 2206	売建	9	アメリカドル	1,056,716.73	122,103,618	1,056,937.5	122,129,128	△1.35
	アメリカ	シカゴ商品取引所	NOTE10Y 2206	売建	23	アメリカドル	2,903,363.37	335,483,638	2,901,953.24	335,320,697	△3.71
	カナダ	モントリオール取引所	CAN-B 2206	売建	13	カナダドル	1,771,068	160,317,075	1,765,790	159,839,310	△1.77
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EU BOBL 2203	売建	15	ユーロ	1,971,600	255,006,744	1,966,800	254,385,912	△2.82
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-B 2203	売建	26	ユーロ	4,324,840	559,374,806	4,319,900	558,735,866	△6.19

	オーストラリア	シドニー先物取引所	AUST10Y 2203	売建	14	オーストラリアドル	1,866,305.84	154,810,069	1,869,269.22	155,055,881	△1.72

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

三菱ＵＦＪ　国内債券アクティブマザーファンド

投資状況

令和 4年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（%）
国債証券	日本	7,642,775,800	59.71
社債券	日本	4,796,400,000	37.47
	スイス	100,130,000	0.78
	小計	4,896,530,000	38.26
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	260,278,276	2.03
純資産総額		12,799,584,076	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

ａ評価額上位３０銘柄

令和 4年 2月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限(年/月/日)	投資比率(%)
日本	国債証券	第３６３回利付国債（１０年）	300,000,000	99.17	297,522,000	99.54	298,623,000	0.100000	2031/6/20	2.33
日本	国債証券	第３６０回利付国債（１０年）	240,000,000	99.57	238,980,000	99.91	239,796,000	0.100000	2030/9/20	1.87
日本	国債証券	第１３６回利付国債（２０年）	190,000,000	113.67	215,980,600	114.02	216,638,000	1.600000	2032/3/20	1.69
日本	社債券	第１４回ＳＢＩホールディングス	200,000,000	100.16	200,322,000	100.15	200,304,000	0.700000	2023/3/27	1.56
日本	社債券	第６回マラヤン・バンキング	200,000,000	99.84	199,688,000	99.85	199,714,000	0.224000	2023/2/13	1.56
日本	社債券	第１６回イオンフィナンシャルサービス	200,000,000	99.62	199,252,000	99.58	199,162,000	0.270000	2025/6/24	1.56
日本	国債証券	第１３０回利付国債（２０年）	150,000,000	115.22	172,830,000	115.49	173,235,000	1.800000	2031/9/20	1.35
日本	国債証券	第３５６回利付国債（１０年）	170,000,000	99.92	169,870,800	100.22	170,382,500	0.100000	2029/9/20	1.33
日本	国債証券	第１５３回利付国債（２０年）	150,000,000	111.60	167,413,500	112.29	168,435,000	1.300000	2035/6/20	1.32
日本	国債証券	第６７回利付国債（３０年）	180,000,000	93.12	167,616,000	93.44	168,197,400	0.600000	2050/6/20	1.31

日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	160,000,000	100.10	160,168,000	100.38	160,617,600	0.100000	2029/3/20	1.25
日本	国債証券	第１５２回利付国債（２０年）	140,000,000	110.29	154,408,800	110.95	155,337,000	1.200000	2035/3/20	1.21
日本	国債証券	第１２５回利付国債（２０年）	130,000,000	118.22	153,686,000	118.57	154,143,600	2.200000	2031/3/20	1.20
日本	国債証券	第１４６回利付国債（２０年）	130,000,000	115.74	150,471,100	116.35	151,256,300	1.700000	2033/9/20	1.18
日本	国債証券	第１２８回利付国債（２０年）	130,000,000	115.85	150,606,300	116.16	151,013,200	1.900000	2031/6/20	1.18
日本	国債証券	第１６９回利付国債（２０年）	150,000,000	95.13	142,707,000	95.67	143,506,500	0.300000	2039/6/20	1.12
日本	国債証券	第１６２回利付国債（２０年）	140,000,000	101.29	141,818,600	101.88	142,637,600	0.600000	2037/9/20	1.11
日本	国債証券	第１５５回利付国債（２０年）	130,000,000	107.65	139,954,100	108.34	140,848,500	1.000000	2035/12/20	1.10
日本	国債証券	第１６４回利付国債（２０年）	140,000,000	99.40	139,169,800	100.07	140,103,600	0.500000	2038/3/20	1.09
日本	国債証券	第５８回利付国債（３０年）	140,000,000	99.35	139,098,400	99.78	139,697,600	0.800000	2048/3/20	1.09
日本	国債証券	第１５０回利付国債（２０年）	120,000,000	112.66	135,195,600	113.31	135,972,000	1.400000	2034/9/20	1.06
日本	国債証券	第１２３回利付国債（２０年）	110,000,000	116.96	128,659,300	117.35	129,089,400	2.100000	2030/12/20	1.01
日本	国債証券	第１４９回利付国債（２０年）	110,000,000	113.80	125,185,500	114.44	125,887,300	1.500000	2034/6/20	0.98
日本	国債証券	第１５９回利付国債（２０年）	120,000,000	101.73	122,078,400	102.36	122,839,200	0.600000	2036/12/20	0.96
日本	国債証券	第１５４回利付国債（２０年）	110,000,000	110.31	121,343,200	111.00	122,100,000	1.200000	2035/9/20	0.95
日本	国債証券	第５４回利付国債（３０年）	120,000,000	100.00	120,000,000	100.41	120,502,800	0.800000	2047/3/20	0.94
日本	国債証券	第１７２回利付国債（２０年）	120,000,000	96.10	115,330,800	96.74	116,090,400	0.400000	2040/3/20	0.91
日本	国債証券	第１４３回利付国債（２０年）	100,000,000	114.25	114,256,000	114.82	114,827,000	1.600000	2033/3/20	0.90
日本	国債証券	第３６１回利付国債（１０年）	110,000,000	99.43	109,376,300	99.82	109,807,500	0.100000	2030/12/20	0.86
日本	国債証券	第１７６回利付国債（２０年）	110,000,000	97.04	106,744,000	97.70	107,475,500	0.500000	2041/3/20	0.84

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

ｂ全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 4年 2月28日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	59.71
社債券	38.26
合計	97.97

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

フランス国債７－１０年ラダーマザーファンド

投資状況

令和 4年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（%）
国債証券	フランス	24,604,015,666	95.41
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	1,183,892,620	4.59
純資産総額		25,787,908,286	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

ａ評価額上位３０銘柄

令和 4年 2月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限(年/月/日)	投資比率(%)
フランス	国債証券	0 O.A.T 291125	33,020,000	13,027.50	4,301,683,622	12,476.33	4,119,684,302	0.000000	2029/11/25	15.98
フランス	国債証券	0 O.A.T 311125	33,900,000	12,696.79	4,304,214,675	12,145.77	4,117,418,122	0.000000	2031/11/25	15.97
フランス	国債証券	0 O.A.T 301125	33,420,000	12,915.74	4,316,442,221	12,317.35	4,116,461,249	0.000000	2030/11/25	15.96
フランス	国債証券	0.5 O.A.T 290525	31,588,000	13,573.32	4,287,542,739	13,022.99	4,113,704,878	0.500000	2029/5/25	15.95
フランス	国債証券	1.5 O.A.T 310525	29,120,000	14,747.73	4,294,541,811	14,018.45	4,082,172,996	1.500000	2031/5/25	15.83
フランス	国債証券	2.5 O.A.T 300525	26,900,000	15,820.19	4,255,633,510	15,072.76	4,054,574,119	2.500000	2030/5/25	15.72

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

ｂ全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 4年 2月28日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	95.41
合計	95.41

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ヘッジ付スペイン国債７－１０年ラダーマザーファンド

投資状況

令和 4年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（%）
国債証券	スペイン	10,203,741,299	95.23
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	510,870,056	4.77
純資産総額		10,714,611,355	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

ａ評価額上位３０銘柄

令和 4年 2月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限(年/月/日)	投資比率(%)
スペイン	国債証券	0.5 SPAIN GOVT 300430	27,180,000	13,338.83	3,625,495,135	12,539.29	3,408,179,870	0.500000	2030/4/30	31.81
スペイン	国債証券	1.45 SPAIN GOVT 290430	25,140,000	14,352.85	3,608,308,954	13,533.72	3,402,378,141	1.450000	2029/4/30	31.75
スペイン	国債証券	0.1 SPAIN GOVT 310430	28,600,000	12,728.34	3,640,307,928	11,864.27	3,393,183,288	0.100000	2031/4/30	31.67

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

ｂ全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 4年 2月28日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	95.23
合計	95.23

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

日本超長期国債インデックスマザーファンド

投資状況

令和 4年 2月28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	147,750,112,200	99.52
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	716,543,746	0.48
純資産総額		148,466,655,946	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

ａ評価額上位３０銘柄

令和 4年 2月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限(年/月/日)	投資比率(%)
日本	国債証券	第１５３回利付国債（２０年）	3,150,000,000	114.69	3,612,735,000	112.29	3,537,135,000	1.300000	2035/6/20	2.38
日本	国債証券	第１４９回利付国債（２０年）	2,720,000,000	116.82	3,177,504,000	114.44	3,112,849,600	1.500000	2034/6/20	2.10
日本	国債証券	第１５５回利付国債（２０年）	2,740,000,000	110.63	3,031,516,800	108.34	2,968,653,000	1.000000	2035/12/20	2.00
日本	国債証券	第１４６回利付国債（２０年）	2,500,000,000	118.64	2,966,054,000	116.35	2,908,775,000	1.700000	2033/9/20	1.96
日本	国債証券	第１４８回利付国債（２０年）	2,420,000,000	116.59	2,821,521,800	114.29	2,765,818,000	1.500000	2034/3/20	1.86
日本	国債証券	第１５２回利付国債（２０年）	2,370,000,000	113.21	2,683,255,600	110.95	2,629,633,500	1.200000	2035/3/20	1.77
日本	国債証券	第１４５回利付国債（２０年）	2,190,000,000	118.20	2,588,622,000	116.13	2,543,268,900	1.700000	2033/6/20	1.71
日本	国債証券	第１４７回利付国債（２０年）	2,190,000,000	117.56	2,574,608,300	115.34	2,526,121,200	1.600000	2033/12/20	1.70
日本	国債証券	第１５７回利付国債（２０年）	2,430,000,000	98.89	2,403,133,600	97.09	2,359,432,800	0.200000	2036/6/20	1.59
日本	国債証券	第１５０回利付国債（２０年）	1,990,000,000	115.68	2,302,131,500	113.31	2,254,869,000	1.400000	2034/9/20	1.52
日本	国債証券	第１６４回利付国債（２０年）	2,200,000,000	102.64	2,258,080,000	100.07	2,201,628,000	0.500000	2038/3/20	1.48

日本	国債証券	第３６回利付国債（３０年）	1,710,000,000	130.65	2,234,185,100	125.39	2,144,237,400	2.000000	2042/3/20	1.44
日本	国債証券	第１７４回利付国債（２０年）	2,200,000,000	99.43	2,187,460,100	96.33	2,119,436,000	0.400000	2040/9/20	1.43
日本	国債証券	第５８回利付国債（３０年）	2,010,000,000	105.45	2,119,691,100	99.78	2,005,658,400	0.800000	2048/3/20	1.35
日本	国債証券	第３７回利付国債（３０年）	1,600,000,000	129.13	2,066,096,000	123.78	1,980,608,000	1.900000	2042/9/20	1.33
日本	国債証券	第１５１回利付国債（２０年）	1,780,000,000	113.23	2,015,573,000	110.89	1,973,895,400	1.200000	2034/12/20	1.33
日本	国債証券	第３５回利付国債（３０年）	1,520,000,000	130.24	1,979,648,000	125.05	1,900,760,000	2.000000	2041/9/20	1.28
日本	国債証券	第３４回利付国債（３０年）	1,480,000,000	133.45	1,975,062,400	128.23	1,897,848,400	2.200000	2041/3/20	1.28
日本	国債証券	第１６０回利付国債（２０年）	1,820,000,000	106.04	1,929,928,000	103.67	1,886,794,000	0.700000	2037/3/20	1.27
日本	国債証券	第１６６回利付国債（２０年）	1,820,000,000	105.64	1,922,648,000	102.82	1,871,360,400	0.700000	2038/9/20	1.26
日本	国債証券	第１７６回利付国債（２０年）	1,860,000,000	101.17	1,881,828,300	97.70	1,817,313,000	0.500000	2041/3/20	1.22
日本	国債証券	第１７８回利付国債（２０年）	1,860,000,000	100.66	1,872,431,000	97.48	1,813,146,600	0.500000	2041/9/20	1.22
日本	国債証券	第３０回利付国債（３０年）	1,380,000,000	133.09	1,836,766,200	128.48	1,773,079,200	2.300000	2039/3/20	1.19
日本	国債証券	第３２回利付国債（３０年）	1,320,000,000	134.13	1,770,516,000	129.26	1,706,337,600	2.300000	2040/3/20	1.15
日本	国債証券	第１０回利付国債（４０年）	1,640,000,000	106.98	1,754,528,900	100.40	1,646,576,400	0.900000	2057/3/20	1.11
日本	国債証券	第１６１回利付国債（２０年）	1,580,000,000	104.47	1,650,777,000	102.07	1,612,769,200	0.600000	2037/6/20	1.09
日本	国債証券	第１６９回利付国債（２０年）	1,680,000,000	98.35	1,652,349,400	95.67	1,607,272,800	0.300000	2039/6/20	1.08
日本	国債証券	第４６回利付国債（３０年）	1,380,000,000	122.14	1,685,566,800	116.45	1,607,106,600	1.500000	2045/3/20	1.08
日本	国債証券	第１７３回利付国債（２０年）	1,620,000,000	99.60	1,613,584,500	96.54	1,563,980,400	0.400000	2040/6/20	1.05
日本	国債証券	第３１回利付国債（３０年）	1,210,000,000	131.82	1,595,108,200	127.12	1,538,260,900	2.200000	2039/9/20	1.04

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

ｂ全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 4年 2月28日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	99.52
合計	99.52

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

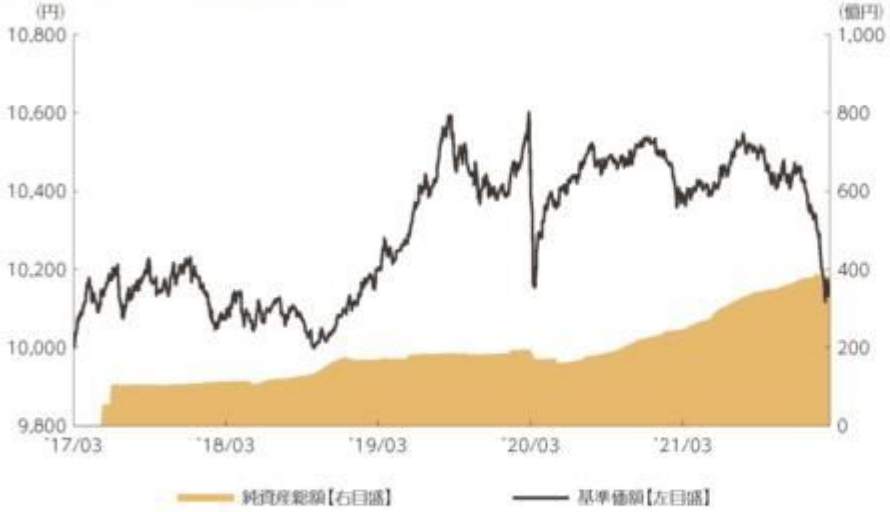
該当事項はありません。

≪参考情報≫

運用実績

2022年2月28日現在

■基準価額・純資産の推移　2017年3月13日(設定日)～2022年2月28日



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

■基準価額・純資産

基準価額	10,157円
純資産総額	381.2億円

•純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2022 年　2月	0円
2021 年　2月	0円
2020 年　2月	0円
2019 年　2月	0円
2018 年　2月	0円
設定来累計	0円

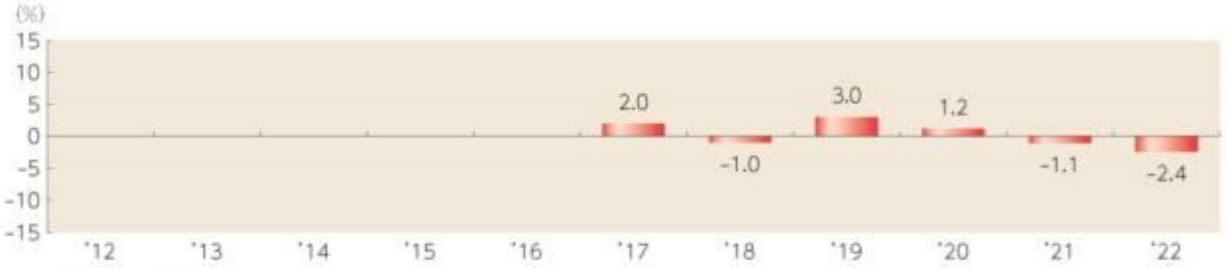
•分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

	組入上位銘柄	比率
1	ショートデュレーション円インカムマザーファンド	22.5%
2	三菱UFJ　国内債券アクティブマザーファンド	19.7%
3	日本債券インデックスマザーファンド	14.8%
4	日本超長期国債インデックスマザーファンド	14.6%
5	AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>(FOFs用)(適格機関投資家限定)*	13.3%
6	MUAM　ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド	7.0%
7	先進国高格付国債マザーファンド	2.0%
8	フランス国債7-10年ラダーマザーファンド	1.9%
9	ヘッジ付スペイン国債7-10年ラダーマザーファンド	1.9%

•比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
*2022年3月26日付で「マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>(FOFs用)(適格機関投資家限定)」に名称変更しています。

■年間収益率の推移



•収益率は基準価額で計算
•2017年は設定日から年末までの、2022年は年初から2月28日までの収益率を表示
•ファンドにベンチマークはありません。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

①申込みの受付
原則として、いつでも申込みができます。
ただし、以下の日は申込みができません。
ニューヨーク証券取引所の休業日の前営業日
ニューヨークの銀行の休業日の前営業日
ロンドン証券取引所の休業日の前営業日
ロンドンの銀行の休業日の前営業日
取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

②申込単位
販売会社が定める単位

③申込価額
取得申込受付日の翌々営業日の基準価額

④申込価額の算出頻度
原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑤申込単位・申込価額の照会方法
申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。
また、下記においてもご照会いただけます。
三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
お客様専用フリーダイヤル　0120-151034
（受付時間：営業日の9:00～17:00）
なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。
ホームページアドレス　https://www.am.mufg.jp/

⑥申込手数料
ありません。

⑦申込方法
取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。
取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。
なお、申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があります。申込みコースの取扱いは販売会社により異なる場合があります。

⑧申込受付時間
取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後３時までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。

⑨取得申込みの受付の中止および取消し
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象証券の取得の制限等）があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことがあります。
また、信託金の限度額に達しない場合でも、ファンドの運用規模・運用効率等を勘案し、市況

動向や資金流入の動向等に応じて、取得の申込みの受付を中止することがあります。

※申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

①解約の受付
原則として、いつでも解約の請求ができます。
ただし、以下の日は解約の請求ができません。
ニューヨーク証券取引所の休業日の前営業日
ニューヨークの銀行の休業日の前営業日
ロンドン証券取引所の休業日の前営業日
ロンドンの銀行の休業日の前営業日
受益者の解約請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

②解約単位
販売会社が定める単位

③解約価額
解約請求受付日の翌々営業日の基準価額

④信託財産留保額
ありません。

⑤解約価額の算出頻度
原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑥解約価額の照会方法
解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。
なお、下記においてもご照会いただけます。
三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
お客様専用フリーダイヤル　0120-151034
（受付時間：営業日の9:00～17:00）
ホームページアドレス　https://www.am.mufg.jp/

⑦支払開始日
解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して７営業日目から販売会社において支払います。

⑧解約請求受付時間
解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後３時までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。

⑨解約請求受付の中止および取消し
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象証券の換金の制限等）があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求を取り消すことがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとします。
また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

①基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口当たりに換算した価額で表示することがあります。

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

（資産の評価方法）

・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券

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

・転換社債／転換社債型新株予約権付社債

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

・公社債等

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

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

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・外貨建資産

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

・外国為替予約取引

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

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

②基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

③基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

2027年2月5日まで（2017年3月13日設定）
ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。また、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

（４）【計算期間】

毎年２月６日から翌年２月５日まで
ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。
なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

①ファンドの償還条件等
委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。（任意償還）
・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合
・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき

このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。
委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。

②信託約款の変更等
委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは受託会社を同一とする他ファンドとの併合を行うことができます。委託会社は、変更または併合しようとするときは、あらかじめその旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。

③ファンドの償還等に関する開示方法
委託会社は、ファンドの任意償還（信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたとき、また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、書面決議の手続を行うことが困難な場合を除きます。）、信託約款の変更または併合（変更にあっては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款変更等」といいます。）をしようとする場合には、書面による決議（「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに任意償還等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、受益者に対し書面をもって書面決議の通知を発します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有

し、これを行使することができます。なお、受益者が議決権を行使しないときは書面決議について賛成するものとみなします。書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上をもって行います。書面決議の効力は、ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
併合に係るいずれかのファンドにおいて、書面決議が否決された場合、併合を行うことはできません。

④反対受益者の受益権買取請求の不適用
委託会社がファンドの任意償還、重大な約款変更等を行う場合、書面決議において反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。この規定は、受益者が自己に帰属する受益権についてその全部または一部の償還を請求したときに、委託会社が信託約款の規定に基づいて信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じることとする場合には適用しません。

⑤関係法人との契約の更改
委託会社と販売会社との間で締結された「投資信託受益権の取扱に関する契約」の契約期間は、契約締結日から１年とします。ただし双方から契約満了日の３ヵ月前までに別段の意思表示のないときは、さらに１年間延長するものとし、その後も同様とします。

⑥運用報告書
委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、交付運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更、ファンドの任意償還等があった場合は、その内容を交付運用報告書に記載します。

⑦委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い
委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

⑧受託会社の辞任および解任に伴う取扱い
受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

⑨信託事務の再信託
受託会社は、ファンドに係る信託事務の処理の一部について再信託受託会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

⑩公告
委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。
https://www.am.mufg.jp/
なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

（１）収益分配金に対する受領権
受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

①分配金受取コース（一般コース）

収益分配金は、税金を差引いた後、毎計算期間の終了日後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して５営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、収益分配金について支払開始日から５年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

②分配金再投資コース（累積投資コース）

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

（２）償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

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

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

（３）換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

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

第３【ファンドの経理状況】

１　当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第２条の２の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

２　当ファンドは、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づき、当期（令和 3年 2月 6日から令和 4年 2月 7日まで）の財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

１【財務諸表】

【国内債券セレクション（ラップ向け）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 ［ 令和 3年 2月 5日現在 ］	第5期 ［ 令和 4年 2月 7日現在 ］
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	554,876,162	940,090,649
投資信託受益証券	2,529,870,506	5,178,955,241
親投資信託受益証券	21,102,853,256	32,339,835,478
流動資産合計	24,187,599,924	38,458,881,368
資産合計	24,187,599,924	38,458,881,368
負債の部		
流動負債		
未払解約金	31,993,100	68,370,084
未払受託者報酬	3,432,745	6,015,908
未払委託者報酬	36,615,821	64,169,583
未払利息	102	420
その他未払費用	411,863	721,845
流動負債合計	72,453,631	139,277,840
負債合計	72,453,631	139,277,840
純資産の部		
元本等		
元本	23,025,291,012	37,497,351,668
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,089,855,281	822,251,860
（分配準備積立金）	446,338,916	525,895,388
元本等合計	24,115,146,293	38,319,603,528
純資産合計	24,115,146,293	38,319,603,528
負債純資産合計	24,187,599,924	38,458,881,368

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 自　令和 2年 2月 6日 至　令和 3年 2月 5日	第5期 自　令和 3年 2月 6日 至　令和 4年 2月 7日
営業収益		
受取利息	2,719	2,521
有価証券売買等損益	60,643,024	△772,983,043
営業収益合計	60,645,743	△772,980,522
営業費用		
支払利息	152,236	166,062
受託者報酬	6,283,290	10,545,105
委託者報酬	67,021,617	112,480,922
その他費用	753,871	1,265,282
営業費用合計	74,211,014	124,457,371
営業利益又は営業損失（△）	△13,565,271	△897,437,893
経常利益又は経常損失（△）	△13,565,271	△897,437,893
当期純利益又は当期純損失（△）	△13,565,271	△897,437,893
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△36,574,137	△13,177,974
期首剰余金又は期首欠損金（△）	834,664,019	1,089,855,281
剰余金増加額又は欠損金減少額	537,176,939	828,424,520
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	537,176,939	828,424,520
剰余金減少額又は欠損金増加額	304,994,543	211,768,022
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	304,994,543	211,768,022
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,089,855,281	822,251,860

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
２.その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年2月5日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は令和 3年 2月 6日から令和 4年 2月 7日までとなっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	第4期 [令和 3年 2月 5日現在]	第5期 [令和 4年 2月 7日現在]
１． 期首元本額	18,454,023,512円	23,025,291,012円
期中追加設定元本額	11,312,543,909円	19,050,884,403円
期中一部解約元本額	6,741,276,409円	4,578,823,747円
２． 受益権の総数	23,025,291,012口	37,497,351,668口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第4期
自 令和 2年 2月 6日
至 令和 3年 2月 5日

１.運用に係る権限を委託するための費用

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

２.分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	103,612,945円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	―円

第5期
自 令和 3年 2月 6日
至 令和 4年 2月 7日

１.運用に係る権限を委託するための費用

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

２.分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	142,952,662円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	―円

第4期 自 令和 2年 2月 6日 至 令和 3年 2月 5日			第5期 自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日		
収益調整金額	C	643,516,365円	収益調整金額	C	1,097,273,104円
分配準備積立金額	D	342,725,971円	分配準備積立金額	D	382,942,726円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,089,855,281円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,623,168,492円
当ファンドの期末残存口数	F	23,025,291,012口	当ファンドの期末残存口数	F	37,497,351,668口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	473円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	432円
1万口当たり分配金額	H	一円	1万口当たり分配金額	H	一円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	一円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	一円

（金融商品に関する注記）

1　金融商品の状況に関する事項

区分	第4期 自 令和 2年 2月 6日 至 令和 3年 2月 5日	第5期 自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第２条第４項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同左

２　金融商品の時価等に関する事項

区分	第4期 ［令和 3年 2月 5日現在］	第5期 ［令和 4年 2月 7日現在］
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
２.時価の算定方法	（１）有価証券	（１）有価証券
	売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	同左
	（２）デリバティブ取引	（２）デリバティブ取引
	デリバティブ取引は、該当事項はありません。	同左
	（３）上記以外の金融商品	（３）上記以外の金融商品
	上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同左
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第4期 ［令和 3年 2月 5日現在］	第5期 ［令和 4年 2月 7日現在］
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）
投資信託受益証券	63,990,157	△213,205,265
親投資信託受益証券	29,068,967	△552,954,854
合計	93,059,124	△766,160,119

（デリバティブ取引に関する注記）
取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	第4期 ［令和 3年 2月 5日現在］	第5期 ［令和 4年 2月 7日現在］
1口当たり純資産額	1.0473円	1.0219円
(1万口当たり純資産額)	(10,473円)	(10,219円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	ＡＭＰ グローバル・インフラ債券ファンド＜為替ヘッジあり＞（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	4,640,640,897	5,178,955,241	
投資信託受益証券 合計		4,640,640,897	5,178,955,241	
親投資信託受益証券	先進国高格付国債マザーファンド	685,139,559	757,969,894	
	日本超長期国債インデックスマザーファンド	5,668,009,280	5,599,426,367	
	フランス国債７－１０年ラダーマザーファンド	680,929,557	740,851,358	
	ショートデュレーション円インカムマザーファンド	8,949,733,665	8,605,168,918	
	ヘッジ付スペイン国債７－１０年ラダーマザーファンド	709,556,243	737,370,847	
	三菱ＵＦＪ　国内債券アクティブマザーファンド	5,188,072,252	7,536,712,560	
	ＭＵＡＭ　ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド	1,602,673,106	2,707,235,410	
	日本債券インデックスマザーファンド	4,248,122,089	5,655,100,124	
親投資信託受益証券 合計		27,732,235,751	32,339,835,478	
合計		32,372,876,648	37,518,790,719	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	［令和 4年 2月 7日現在］
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,993,130,352
国債証券	546,949,021,730
地方債証券	35,904,956,908
特殊債券	34,091,442,434
社債券	35,110,570,000
未収入金	1,508,348,000
未収利息	1,059,554,793
前払金	8,200,000
前払費用	206,588,919
差入委託証拠金	3,150,000
流動資産合計	656,834,963,136
資産合計	656,834,963,136
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,305,500
未払金	1,802,370,000
未払解約金	303,680,288
未払利息	890
流動負債合計	2,114,356,678
負債合計	2,114,356,678
純資産の部	
元本等	
元本	491,810,722,355
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	162,909,884,103
元本等合計	654,720,606,458
純資産合計	654,720,606,458
負債純資産合計	656,834,963,136

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。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 4年 2月 7日現在]
１．期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	240,296,636,471円
期中追加設定元本額	326,680,315,058円
期中一部解約元本額	75,166,229,174円
元本の内訳※	
三菱ＵＦＪ　ライフセレクトファンド（安定型）	6,299,038,275円
三菱ＵＦＪ　ライフセレクトファンド（安定成長型）	7,767,621,167円
三菱ＵＦＪ　ライフセレクトファンド（成長型）	1,885,339,779円
三菱ＵＦＪ　プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	48,789,345,811円
三菱ＵＦＪ　プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	79,427,445,076円
三菱ＵＦＪ　プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	21,907,209,936円
三菱ＵＦＪ　６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）	196,053,858円
三菱ＵＦＪ　６資産バランスファンド（成長型）	160,117,071円
三菱ＵＦＪ　国内債券インデックスファンド	2,365,755,396円
ｅＭＡＸＩＳ　国内債券インデックス	6,652,469,549円
ｅＭＡＸＩＳ　バランス（８資産均等型）	3,301,465,990円
ｅＭＡＸＩＳ　バランス（波乗り型）	158,514,552円
三菱ＵＦＪ　プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	10,726,682,388円
三菱ＵＦＪ　国内債券インデックスファンド（確定拠出年金）	36,653,526,896円
コアバランス	2,344,768円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０３０（確定拠出年金）	3,863,401,318円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０４０（確定拠出年金）	1,588,523,726円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０５０（確定拠出年金）	612,309,915円
ｅＭＡＸＩＳ　Ｓｌｉｍ　国内債券インデックス	12,016,632,942円
国内債券セレクション（ラップ向け）	4,248,122,089円
ｅＭＡＸＩＳ　Ｓｌｉｍ　バランス（８資産均等型）	11,211,493,993円
つみたて８資産均等バランス	5,004,769,685円
つみたて４資産均等バランス	1,584,610,347円
ｅＭＡＸＩＳ　マイマネージャー　１９７０ｓ	8,837,596円
ｅＭＡＸＩＳ　マイマネージャー　１９８０ｓ	5,960,552円

	[令和 4年 2月 7日現在]
ｅＭＡＸＩＳ　マイマネージャー　１９９０ｓ	152,887円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０３５（確定拠出年金）	1,804,796,510円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０４５（確定拠出年金）	599,760,408円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０５５（確定拠出年金）	216,690,093円
三菱ＵＦＪ　ＤＣ年金バランス（株式１５）	2,644,245,030円
三菱ＵＦＪ　ＤＣ年金バランス（株式４０）	2,231,164,407円
三菱ＵＦＪ　ＤＣ年金バランス（株式６５）	944,971,431円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金）	191,984,171円
三菱ＵＦＪ　ＤＣ年金バランス（株式２５）	597,620,784円
国内債券インデックスファンド（ラップ向け）	1,576,896,482円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０６５（確定拠出年金）	39,888,357円
ラップ向けインデックスｆ　国内債券	4,014,141,881円
ＭＵＦＧ　ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）	1,169,946,023円
ＭＵＦＧ　ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）	1,289,287,913円
ＭＵＦＧ　ウェルス・インサイト・ファンド（積極型）	2,007,378円
三菱ＵＦＪ　ＤＣ年金バランス（株式８０）	145,184円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定型）	94,086,791円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定成長型）	105,076,539円
ｅＭＡＸＩＳ　債券バランス（２資産均等型）	69,682,818円
ｅＭＡＸＩＳ　バランス（４資産均等型）	848,648,526円
ｅＭＡＸＩＳ　最適化バランス（マイゴールキーパー）	1,330,738,699円
ｅＭＡＸＩＳ　最適化バランス（マイディフェンダー）	753,201,295円
ｅＭＡＸＩＳ　最適化バランス（マイミッドフィルダー）	1,430,236,299円
ｅＭＡＸＩＳ　最適化バランス（マイフォワード）	191,115,399円
ｅＭＡＸＩＳ　最適化バランス（マイストライカー）	25,114,391円
三菱ＵＦＪ　日本債券ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	8,435,855,560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）	127,520円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	54,432,857円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,716,403,682円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　２０型（適格機関投資家限定）	971,338,653円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　４０型（適格機関投資家限定）	4,827,841,429円
ＭＵＡＭ　日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	129,100,969,693円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　５０型（適格機関投資家限定）	516,756,844円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,929,151円

	[令和 4年 2月 7日現在]
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　３０型（適格機関投資家限定）	2,262,981円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,627,244,590円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,083,237,106円
ＭＵＫＡＭ　スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	4,194,172,585円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	348,626,576円
ＭＵＫＡＭ　日本債券インデックスファンド２（適格機関投資家限定）	13,499,184,139円
ＭＵＫＡＭ　スマート・クオリティ・セレクション２（適格機関投資家限定）	3,909,375,968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）	2,360,024円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２０－０７（適格機関投資家限定）	464,386,656円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	463,972,979円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２０－１１（適格機関投資家限定）	464,110,790円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２１－０１（適格機関投資家限定）	463,279,640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）	464,649,283円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２１－０５（適格機関投資家限定）	464,386,656円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２１－０７（適格機関投資家限定）	459,088,162円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	459,282,676円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２１－１１（適格機関投資家限定）	464,041,874円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２２－０１（適格機関投資家限定）	465,944,536円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	16,716,553円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	27,124,198円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	8,137,078円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	8,304,903円
三菱ＵＦＪ　バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	32,693,712円
三菱ＵＦＪ　バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	92,157,166円
三菱ＵＦＪ　バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	25,113,784円
三菱ＵＦＪ　バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	64,565,578円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞日本債券インデックスファンド	4,274,021,281円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス　ファンド（安定型）	1,985,202,785円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス　ファンド（安定成長型）	3,923,333,160円

	[令和 4年 2月 7日現在]
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス　ファンド（成長型）	2,321,411,680円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス　ファンド（積極型）	1,478,485,496円
合計	491,810,722,355円
２．　受益権の総数	491,810,722,355口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

１　金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第２条第４項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
２.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、債券先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
３.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

２　金融商品の時価等に関する事項

区分	［令和 4年 2月 7日現在］
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
２.時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。

区分	［令和 4年 2月 7日現在］
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	［令和 4年 2月 7日現在］
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△9,349,208,520
地方債証券	△256,278,603
特殊債券	△260,511,595
社債券	△157,009,500
合計	△10,023,008,218

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

債券関連

［令和 4年 2月 7日現在］

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	債券先物取引				
	買建	759,900,000	—	751,600,000	△8,300,000
合計		759,900,000	—	751,600,000	△8,300,000

（注）時価の算定方法

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

2　先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	［令和 4年 2月 7日現在］
1口当たり純資産額	1.3312円
(1万口当たり純資産額)	(13,312円)

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第４２２回利付国債（２年）	1,920,000,000	1,923,648,000	
	第４２３回利付国債（２年）	4,300,000,000	4,303,913,000	
	第４２４回利付国債（２年）	3,540,000,000	3,543,469,200	
	第４２５回利付国債（２年）	1,300,000,000	1,301,352,000	
	第４２６回利付国債（２年）	4,530,000,000	4,534,711,200	
	第４２７回利付国債（２年）	4,860,000,000	4,865,005,800	
	第４２８回利付国債（２年）	300,000,000	300,327,000	
	第４２９回利付国債（２年）	1,770,000,000	1,772,035,500	
	第４３０回利付国債（２年）	3,000,000,000	3,003,360,000	
	第４３１回利付国債（２年）	550,000,000	550,594,000	
	第４３２回利付国債（２年）	1,600,000,000	1,601,808,000	
	第１３５回利付国債（５年）	1,200,000,000	1,202,328,000	
	第１３６回利付国債（５年）	2,520,000,000	2,525,821,200	
	第１３７回利付国債（５年）	3,520,000,000	3,529,363,200	
	第１３８回利付国債（５年）	6,250,000,000	6,268,625,000	
	第１３９回利付国債（５年）	2,520,000,000	2,527,963,200	
	第１４０回利付国債（５年）	4,840,000,000	4,856,552,800	
	第１４１回利付国債（５年）	3,340,000,000	3,352,224,400	
	第１４２回利付国債（５年）	360,000,000	361,389,600	
	第１４３回利付国債（５年）	4,760,000,000	4,779,230,400	
	第１４４回利付国債（５年）	5,330,000,000	5,354,198,200	
	第１４５回利付国債（５年）	4,490,000,000	4,511,103,000	
	第１４６回利付国債（５年）	6,260,000,000	6,290,235,800	
	第１４７回利付国債（５年）	2,090,000,000	2,092,131,800	
	第１４８回利付国債（５年）	1,750,000,000	1,751,522,500	
	第１４９回利付国債（５年）	8,780,000,000	8,784,038,800	
	第１５０回利付国債（５年）	500,000,000	500,000,000	

第１回利付国債（４０年）	445,000,000	618,136,150	
第２回利付国債（４０年）	885,000,000	1,190,183,400	
第３回利付国債（４０年）	718,000,000	969,824,140	
第４回利付国債（４０年）	1,048,000,000	1,424,693,120	
第５回利付国債（４０年）	1,065,000,000	1,400,592,150	
第６回利付国債（４０年）	1,230,000,000	1,592,813,100	
第７回利付国債（４０年）	1,310,000,000	1,632,037,300	
第８回利付国債（４０年）	1,510,000,000	1,760,977,100	
第９回利付国債（４０年）	2,390,000,000	2,086,278,800	
第１０回利付国債（４０年）	2,240,000,000	2,285,718,400	
第１１回利付国債（４０年）	1,850,000,000	1,829,483,500	
第１２回利付国債（４０年）	1,740,000,000	1,552,845,600	
第１３回利付国債（４０年）	2,230,000,000	1,985,324,400	
第１４回利付国債（４０年）	2,270,000,000	2,154,230,000	
第３２８回利付国債（１０年）	3,570,000,000	3,596,739,300	
第３２９回利付国債（１０年）	4,690,000,000	4,745,248,200	
第３３０回利付国債（１０年）	3,180,000,000	3,224,170,200	
第３３１回利付国債（１０年）	1,400,000,000	1,414,924,000	
第３３２回利付国債（１０年）	2,920,000,000	2,955,653,200	
第３３３回利付国債（１０年）	3,950,000,000	4,003,759,500	
第３３４回利付国債（１０年）	3,990,000,000	4,050,807,600	
第３３５回利付国債（１０年）	3,890,000,000	3,944,926,800	
第３３６回利付国債（１０年）	2,460,000,000	2,497,711,800	
第３３７回利付国債（１０年）	1,620,000,000	1,635,552,000	
第３３８回利付国債（１０年）	3,330,000,000	3,374,555,400	
第３３９回利付国債（１０年）	4,020,000,000	4,078,852,800	
第３４０回利付国債（１０年）	3,470,000,000	3,523,958,500	
第３４１回利付国債（１０年）	3,320,000,000	3,361,699,200	
第３４２回利付国債（１０年）	3,720,000,000	3,738,339,600	
第３４３回利付国債（１０年）	4,870,000,000	4,894,398,700	
第３４４回利付国債（１０年）	4,620,000,000	4,642,360,800	
第３４５回利付国債（１０年）	6,340,000,000	6,369,227,400	
第３４６回利付国債（１０年）	5,930,000,000	5,957,218,700	
第３４７回利付国債（１０年）	5,250,000,000	5,273,887,500	
第３４８回利付国債（１０年）	6,460,000,000	6,488,940,800	
第３４９回利付国債（１０年）	5,750,000,000	5,775,242,500	
第３５０回利付国債（１０年）	7,520,000,000	7,549,779,200	
第３５１回利付国債（１０年）	3,650,000,000	3,663,870,000	
第３５２回利付国債（１０年）	3,750,000,000	3,762,337,500	
第３５３回利付国債（１０年）	4,230,000,000	4,242,986,100	
第３５５回利付国債（１０年）	4,600,000,000	4,610,074,000	
第３５６回利付国債（１０年）	6,680,000,000	6,690,086,800	

第３５７回利付国債（１０年）	4,480,000,000	4,483,494,400	
第３５８回利付国債（１０年）	6,130,000,000	6,130,000,000	
第３５９回利付国債（１０年）	6,380,000,000	6,374,704,600	
第３６０回利付国債（１０年）	6,720,000,000	6,705,619,200	
第３６１回利付国債（１０年）	4,130,000,000	4,115,503,700	
第３６２回利付国債（１０年）	5,310,000,000	5,283,715,500	
第３６３回利付国債（１０年）	9,150,000,000	9,090,891,000	
第３６４回利付国債（１０年）	7,420,000,000	7,360,417,400	
第３６５回利付国債（１０年）	1,300,000,000	1,288,040,000	
第１回利付国債（３０年）	196,000,000	236,254,480	
第２回利付国債（３０年）	268,000,000	317,370,960	
第３回利付国債（３０年）	307,000,000	362,441,130	
第４回利付国債（３０年）	252,000,000	312,737,040	
第５回利付国債（３０年）	238,000,000	282,508,380	
第６回利付国債（３０年）	339,000,000	411,532,440	
第７回利付国債（３０年）	339,000,000	410,478,150	
第８回利付国債（３０年）	302,000,000	351,718,260	
第９回利付国債（３０年）	206,000,000	231,175,260	
第１０回利付国債（３０年）	398,000,000	434,098,600	
第１１回利付国債（３０年）	237,000,000	274,509,990	
第１２回利付国債（３０年）	325,000,000	391,969,500	
第１３回利付国債（３０年）	595,000,000	712,090,050	
第１４回利付国債（３０年）	683,000,000	851,591,720	
第１５回利付国債（３０年）	686,000,000	865,889,780	
第１６回利付国債（３０年）	547,000,000	692,835,670	
第１７回利付国債（３０年）	577,000,000	725,271,690	
第１８回利付国債（３０年）	687,000,000	857,059,980	
第１９回利付国債（３０年）	593,000,000	741,546,500	
第２０回利付国債（３０年）	655,000,000	838,537,550	
第２１回利付国債（３０年）	529,000,000	664,942,420	
第２２回利付国債（３０年）	695,000,000	894,701,300	
第２３回利付国債（３０年）	194,000,000	250,349,240	
第２４回利付国債（３０年）	541,000,000	700,270,400	
第２５回利付国債（３０年）	647,000,000	820,603,040	
第２６回利付国債（３０年）	1,014,000,000	1,303,882,320	
第２７回利付国債（３０年）	460,000,000	600,635,800	
第２８回利付国債（３０年）	1,026,000,000	1,345,968,360	
第２９回利付国債（３０年）	530,000,000	689,757,900	
第３０回利付国債（３０年）	1,421,000,000	1,832,805,800	
第３１回利付国債（３０年）	1,583,000,000	2,021,902,580	
第３２回利付国債（３０年）	1,309,000,000	1,698,846,380	
第３３回利付国債（３０年）	1,317,000,000	1,646,394,870	

第３４回利付国債（３０年）	1,661,000,000	2,140,464,260	
第３５回利付国債（３０年）	2,029,000,000	2,549,844,300	
第３６回利付国債（３０年）	1,929,000,000	2,431,041,540	
第３７回利付国債（３０年）	2,037,000,000	2,534,394,660	
第３８回利付国債（３０年）	1,470,000,000	1,805,571,600	
第３９回利付国債（３０年）	1,270,000,000	1,587,119,000	
第４０回利付国債（３０年）	1,640,000,000	2,018,446,400	
第４１回利付国債（３０年）	990,000,000	1,199,315,700	
第４２回利付国債（３０年）	1,370,000,000	1,660,919,500	
第４３回利付国債（３０年）	1,400,000,000	1,698,606,000	
第４４回利付国債（３０年）	1,470,000,000	1,784,859,300	
第４５回利付国債（３０年）	1,160,000,000	1,360,320,400	
第４６回利付国債（３０年）	2,000,000,000	2,346,260,000	
第４７回利付国債（３０年）	1,490,000,000	1,780,699,000	
第４８回利付国債（３０年）	1,830,000,000	2,108,800,500	
第４９回利付国債（３０年）	1,720,000,000	1,982,386,000	
第５０回利付国債（３０年）	1,910,000,000	1,949,384,200	
第５１回利付国債（３０年）	1,670,000,000	1,516,760,800	
第５２回利付国債（３０年）	1,850,000,000	1,759,368,500	
第５３回利付国債（３０年）	1,580,000,000	1,535,159,600	
第５４回利付国債（３０年）	1,420,000,000	1,442,620,600	
第５５回利付国債（３０年）	1,410,000,000	1,431,107,700	
第５６回利付国債（３０年）	1,970,000,000	1,997,599,700	
第５７回利付国債（３０年）	1,200,000,000	1,215,624,000	
第５８回利付国債（３０年）	2,580,000,000	2,608,147,800	
第５９回利付国債（３０年）	1,440,000,000	1,419,465,600	
第６０回利付国債（３０年）	1,640,000,000	1,690,823,600	
第６１回利付国債（３０年）	1,400,000,000	1,373,596,000	
第６２回利付国債（３０年）	1,370,000,000	1,274,168,500	
第６３回利付国債（３０年）	1,530,000,000	1,381,758,300	
第６４回利付国債（３０年）	1,550,000,000	1,397,123,500	
第６５回利付国債（３０年）	1,460,000,000	1,313,459,800	
第６６回利付国債（３０年）	1,160,000,000	1,042,747,200	
第６７回利付国債（３０年）	2,420,000,000	2,289,586,200	
第６８回利付国債（３０年）	1,520,000,000	1,439,151,200	
第６９回利付国債（３０年）	1,660,000,000	1,613,503,400	
第７０回利付国債（３０年）	1,830,000,000	1,778,375,700	
第７１回利付国債（３０年）	2,030,000,000	1,972,348,000	
第７２回利付国債（３０年）	1,960,000,000	1,901,690,000	
第７３回利付国債（３０年）	330,000,000	320,116,500	
第６１回利付国債（２０年）	549,000,000	555,549,570	
第６２回利付国債（２０年）	560,000,000	566,596,800	

第６３回利付国債（２０年）	617,000,000	632,677,970	
第６４回利付国債（２０年）	821,000,000	846,984,650	
第６５回利付国債（２０年）	648,000,000	671,619,600	
第６６回利付国債（２０年）	240,000,000	248,301,600	
第６７回利付国債（２０年）	80,000,000	83,285,600	
第６８回利付国債（２０年）	1,041,000,000	1,090,343,400	
第６９回利付国債（２０年）	120,000,000	125,434,800	
第７０回利付国債（２０年）	732,000,000	774,214,440	
第７１回利付国債（２０年）	360,000,000	379,062,000	
第７２回利付国債（２０年）	1,079,000,000	1,139,413,210	
第７３回利付国債（２０年）	520,000,000	550,243,200	
第７４回利付国債（２０年）	698,000,000	740,598,940	
第７５回利付国債（２０年）	705,000,000	751,621,650	
第７６回利付国債（２０年）	410,000,000	434,559,000	
第７７回利付国債（２０年）	370,000,000	393,313,700	
第７８回利付国債（２０年）	310,000,000	330,075,600	
第７９回利付国債（２０年）	150,000,000	160,219,500	
第８０回利付国債（２０年）	585,000,000	626,821,650	
第８１回利付国債（２０年）	250,000,000	268,310,000	
第８２回利付国債（２０年）	1,082,000,000	1,165,162,520	
第８３回利付国債（２０年）	395,000,000	427,370,250	
第８４回利付国債（２０年）	880,000,000	948,719,200	
第８５回利付国債（２０年）	520,000,000	565,338,800	
第８６回利付国債（２０年）	1,047,000,000	1,146,904,740	
第８７回利付国債（２０年）	420,000,000	458,346,000	
第８８回利付国債（２０年）	1,264,000,000	1,391,701,920	
第８９回利付国債（２０年）	340,000,000	372,867,800	
第９０回利付国債（２０年）	1,270,000,000	1,399,222,500	
第９１回利付国債（２０年）	548,000,000	606,290,760	
第９２回利付国債（２０年）	1,282,000,000	1,412,571,700	
第９３回利付国債（２０年）	190,000,000	209,307,800	
第９４回利付国債（２０年）	875,000,000	968,388,750	
第９５回利付国債（２０年）	1,107,000,000	1,242,507,870	
第９６回利付国債（２０年）	340,000,000	377,978,000	
第９７回利付国債（２０年）	573,000,000	643,043,520	
第９８回利付国債（２０年）	610,000,000	681,144,300	
第９９回利付国債（２０年）	1,480,000,000	1,659,775,600	
第１００回利付国債（２０年）	1,030,000,000	1,165,949,700	
第１０１回利付国債（２０年）	723,000,000	827,242,140	
第１０２回利付国債（２０年）	520,000,000	597,870,000	
第１０３回利付国債（２０年）	760,000,000	868,984,000	
第１０４回利付国債（２０年）	610,000,000	689,733,100	

第１０５回利付国債（２０年）	920,000,000	1,044,319,600	
第１０６回利付国債（２０年）	571,000,000	651,922,120	
第１０７回利付国債（２０年）	607,000,000	691,870,740	
第１０８回利付国債（２０年）	1,000,000,000	1,126,140,000	
第１０９回利付国債（２０年）	560,000,000	632,945,600	
第１１０回利付国債（２０年）	876,000,000	1,002,503,160	
第１１１回利付国債（２０年）	861,000,000	995,307,390	
第１１２回利付国債（２０年）	1,050,000,000	1,206,103,500	
第１１３回利付国債（２０年）	922,000,000	1,063,342,600	
第１１４回利付国債（２０年）	1,600,000,000	1,851,808,000	
第１１５回利付国債（２０年）	944,000,000	1,099,939,360	
第１１６回利付国債（２０年）	461,000,000	539,093,400	
第１１７回利付国債（２０年）	1,320,000,000	1,532,982,000	
第１１８回利付国債（２０年）	520,000,000	601,676,400	
第１１９回利付国債（２０年）	400,000,000	456,196,000	
第１２０回利付国債（２０年）	780,000,000	876,649,800	
第１２１回利付国債（２０年）	1,299,000,000	1,496,123,250	
第１２２回利付国債（２０年）	100,000,000	114,322,000	
第１２３回利付国債（２０年）	1,318,000,000	1,545,499,980	
第１２４回利付国債（２０年）	1,240,000,000	1,443,174,000	
第１２５回利付国債（２０年）	1,844,000,000	2,184,697,440	
第１２６回利付国債（２０年）	200,000,000	233,354,000	
第１２７回利付国債（２０年）	440,000,000	509,423,200	
第１２８回利付国債（２０年）	1,974,000,000	2,290,787,520	
第１２９回利付国債（２０年）	280,000,000	322,352,800	
第１３０回利付国債（２０年）	1,862,000,000	2,148,059,060	
第１３１回利付国債（２０年）	420,000,000	480,555,600	
第１３２回利付国債（２０年）	187,000,000	214,440,380	
第１３３回利付国債（２０年）	2,320,000,000	2,682,917,600	
第１３４回利付国債（２０年）	2,455,000,000	2,844,215,700	
第１３５回利付国債（２０年）	50,000,000	57,431,500	
第１３６回利付国債（２０年）	190,000,000	216,356,800	
第１３７回利付国債（２０年）	2,392,000,000	2,752,019,920	
第１３８回利付国債（２０年）	360,000,000	406,886,400	
第１３９回利付国債（２０年）	310,000,000	353,517,800	
第１４０回利付国債（２０年）	2,717,000,000	3,130,799,100	
第１４１回利付国債（２０年）	1,120,000,000	1,293,118,400	
第１４２回利付国債（２０年）	2,000,000,000	2,330,300,000	
第１４３回利付国債（２０年）	1,840,000,000	2,107,352,000	
第１４４回利付国債（２０年）	400,000,000	453,800,000	
第１４５回利付国債（２０年）	3,060,000,000	3,544,306,200	
第１４６回利付国債（２０年）	2,900,000,000	3,365,073,000	

	第１４７回利付国債（２０年）	2,910,000,000	3,347,169,300	
	第１４８回利付国債（２０年）	2,510,000,000	2,861,952,200	
	第１４９回利付国債（２０年）	3,190,000,000	3,641,927,300	
	第１５０回利付国債（２０年）	2,840,000,000	3,211,869,600	
	第１５１回利付国債（２０年）	2,710,000,000	2,999,048,600	
	第１５２回利付国債（２０年）	2,590,000,000	2,867,725,700	
	第１５３回利付国債（２０年）	3,060,000,000	3,428,852,400	
	第１５４回利付国債（２０年）	2,670,000,000	2,959,134,300	
	第１５５回利付国債（２０年）	2,450,000,000	2,650,018,000	
	第１５６回利付国債（２０年）	2,910,000,000	2,908,050,300	
	第１５７回利付国債（２０年）	3,060,000,000	2,968,812,000	
	第１５８回利付国債（２０年）	2,450,000,000	2,476,974,500	
	第１５９回利付国債（２０年）	3,020,000,000	3,091,694,800	
	第１６０回利付国債（２０年）	2,170,000,000	2,251,526,900	
	第１６１回利付国債（２０年）	2,410,000,000	2,461,935,500	
	第１６２回利付国債（２０年）	3,260,000,000	3,326,471,400	
	第１６３回利付国債（２０年）	2,310,000,000	2,354,328,900	
	第１６４回利付国債（２０年）	3,130,000,000	3,137,011,200	
	第１６５回利付国債（２０年）	2,480,000,000	2,481,860,000	
	第１６６回利付国債（２０年）	3,150,000,000	3,246,610,500	
	第１６７回利付国債（２０年）	2,540,000,000	2,532,100,600	
	第１６８回利付国債（２０年）	2,120,000,000	2,075,119,600	
	第１６９回利付国債（２０年）	2,450,000,000	2,352,906,500	
	第１７０回利付国債（２０年）	1,490,000,000	1,427,881,900	
	第１７１回利付国債（２０年）	2,150,000,000	2,055,873,000	
	第１７２回利付国債（２０年）	2,360,000,000	2,292,244,400	
	第１７３回利付国債（２０年）	2,730,000,000	2,646,243,600	
	第１７４回利付国債（２０年）	3,410,000,000	3,301,323,300	
	第１７５回利付国債（２０年）	2,390,000,000	2,351,473,200	
	第１７６回利付国債（２０年）	2,860,000,000	2,808,548,600	
	第１７７回利付国債（２０年）	2,630,000,000	2,532,164,000	
	第１７８回利付国債（２０年）	3,270,000,000	3,204,174,900	
	第１７９回利付国債（２０年）	420,000,000	411,448,800	
国債証券 合計		522,844,000,000	546,949,021,730	
地方債証券	第１回東京都公募公債（２０年）	20,000,000	20,417,200	
	第４回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	211,556,000	
	第５回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	106,515,000	
	第７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	107,731,000	
	第７回東京都公募公債（３０年）	80,000,000	104,437,600	
	第１０回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	128,314,000	
	第２０回東京都公募公債（２０年）	80,000,000	91,548,800	
	第２１回東京都公募公債（２０年）	80,000,000	92,471,200	

第２８回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	113,503,000	
第３３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	95,843,000	
第７１９回東京都公募公債	300,000,000	302,835,000	
第７２２回東京都公募公債	100,000,000	101,076,000	
第７２４回東京都公募公債	800,000,000	808,928,000	
第７２８回東京都公募公債	900,000,000	910,728,000	
第７２９回東京都公募公債	200,000,000	202,868,000	
第７３０回東京都公募公債	100,000,000	101,379,000	
第７３３回東京都公募公債	700,000,000	709,443,000	
第７３８回東京都公募公債	100,000,000	101,194,000	
第７８２回東京都公募公債	100,000,000	100,599,000	
第８０９回東京都公募公債	100,000,000	99,027,000	
第３回東京都公募公債（２０年）	400,000,000	418,980,000	
平成２５年度第７回北海道公募公債	150,000,000	151,848,000	
平成２６年度第９回北海道公募公債	100,000,000	101,391,000	
平成２６年度第１３回北海道公募公債	100,000,000	101,302,000	
平成２７年度第５回北海道公募公債	100,000,000	101,891,000	
第２９回１号宮城県公募公債	300,000,000	303,441,000	
第２回神奈川県公募公債（２０年）	680,000,000	719,480,800	
第２回神奈川県公募公債（３０年）	180,000,000	239,331,600	
第４回神奈川県公募公債（３０年）	100,000,000	131,748,000	
第２７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	112,125,000	
第２３４回神奈川県公募公債	100,000,000	100,750,000	
第１１回大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	114,883,000	
第１５３回大阪府公募公債（５年）	300,000,000	299,958,000	
第１８４回大阪府公募公債（５年）	120,000,000	119,794,800	
第３５９回大阪府公募公債	56,000,000	56,075,040	
第３７２回大阪府公募公債	200,000,000	201,686,000	
第３７５回大阪府公募公債	100,000,000	101,285,000	
第３７６回大阪府公募公債	106,000,000	107,405,560	
第３７８回大阪府公募公債	100,000,000	101,245,000	
第３８５回大阪府公募公債	200,000,000	203,048,000	
第３８８回大阪府公募公債	200,000,000	202,788,000	
第３９１回大阪府公募公債	210,000,000	213,015,600	
第３９３回大阪府公募公債	110,000,000	111,523,500	
第４３５回大阪府公募公債	130,000,000	130,379,600	
第４６０回大阪府公募公債	194,000,000	192,110,440	
第４６４回大阪府公募公債	800,000,000	788,192,000	
第４６７回大阪府公募公債	500,000,000	495,900,000	
平成２６年度第２回京都府公募公債（１５年）	200,000,000	212,998,000	
平成２６年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	112,769,000	
第１回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	102,595,000	

第１回兵庫県公募公債（１５年）	300,000,000	321,690,000	
第２回兵庫県公募公債（３０年）	90,000,000	116,777,700	
平成２５年度第４回兵庫県公募公債	100,000,000	101,236,000	
第２７回兵庫県公募公債（２０年）	200,000,000	197,530,000	
第６回静岡県公募公債（１５年）	300,000,000	319,497,000	
第１１回静岡県公募公債（２０年）	550,000,000	626,048,500	
第１４回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	114,599,000	
平成２５年度第１回静岡県公募公債	100,000,000	100,681,000	
平成２５年度第５回静岡県公募公債	290,000,000	293,877,300	
平成２５年度第７回静岡県公募公債	100,000,000	101,280,000	
平成２５年度第８回静岡県公募公債	159,800,000	161,682,444	
平成２６年度第３回静岡県公募公債	800,000,000	812,296,000	
令和２年度第１５回静岡県公募公債（５年）	120,000,000	119,900,400	
令和２年度第１３回静岡県公募公債（５年）	120,000,000	119,900,400	
平成２０年度第８回愛知県公募公債（２０年）	200,000,000	225,688,000	
平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	700,000,000	808,010,000	
平成２５年度第１６回愛知県公募公債	700,000,000	708,267,000	
平成２６年度第７回愛知県公募公債	600,000,000	608,604,000	
平成２６年度第１５回愛知県公募公債	200,000,000	202,698,000	
平成２７年度第７回愛知県公募公債	100,000,000	101,831,000	
平成３０年度第５回愛知県公募公債	100,000,000	100,348,000	
平成３０年度第８回愛知県公募公債	200,000,000	201,428,000	
平成２６年度第７回広島県公募公債	260,000,000	263,580,200	
平成２８年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	98,887,000	
平成３０年度第４回広島県公募公債	200,000,000	201,464,000	
第１０回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	114,785,000	
第１４回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	227,432,000	
第１６回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	110,106,000	
平成２６年度第８回埼玉県公募公債	100,000,000	100,953,000	
平成３０年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	100,411,000	
令和３年度第２回埼玉県公募公債（５年）	110,000,000	109,884,500	
平成１９年度第１回福岡県公募公債（３０年）	70,000,000	91,705,600	
平成２０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	80,000,000	101,463,200	
平成２２年度第２回福岡県公募公債（２０年）	800,000,000	934,000,000	
平成２５年度第９回福岡県公募公債	100,000,000	101,349,000	
平成２６年度第８回福岡県公募公債	200,000,000	202,456,000	
平成２６年度第１回福岡県公募公債	100,000,000	101,533,000	
平成２７年度第７回福岡県公募公債	100,000,000	101,681,000	
令和２年度第４回福岡県公募公債	200,000,000	198,646,000	
第９回千葉県公募公債（２０年）	80,000,000	91,030,400	
平成２５年度第１回千葉県公募公債	82,500,000	83,068,425	
平成２５年度第８回千葉県公募公債	100,000,000	101,183,000	

平成２７年度第３回千葉県公募公債	200,000,000	203,402,000	
平成２８年度第３回千葉県公募公債	400,000,000	400,176,000	
平成２７年度第２回新潟県公募公債	100,000,000	100,748,000	
平成３０年度第３回茨城県公募公債（５年）	150,000,000	150,046,500	
第７回群馬県公募公債（２０年）	100,000,000	97,698,000	
平成２７年度第１回岐阜県公募公債	300,000,000	305,361,000	
令和２年度第２回岐阜県公募公債（５年）	100,000,000	99,982,000	
平成２５年度第１回大分県公募公債	103,250,000	104,445,635	
平成２７年度第１回大分県公募公債	203,400,000	206,819,154	
第１２３回共同発行市場公募地方債	700,000,000	708,253,000	
第１２４回共同発行市場公募地方債	700,000,000	709,198,000	
第１２５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,252,000	
第１２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,147,000	
第１２８回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,495,000	
第１３０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,944,000	
第１３１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,327,000	
第１３２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,382,000	
第１３３回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,002,000	
第１３４回共同発行市場公募地方債	250,000,000	253,802,500	
第１３５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,086,000	
第１３６回共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,431,000	
第１４０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,770,000	
第１４２回共同発行市場公募地方債	400,000,000	403,916,000	
第１４４回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,818,000	
第１４５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,240,000	
第１５１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,272,000	
第１５８回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,384,000	
第１８５回共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,944,000	
平成３０年度第１回福島県公募公債	100,000,000	100,768,000	
平成２５年度第１回栃木県公募公債	100,000,000	101,156,000	
平成２４年度第２回熊本県公募公債	50,000,000	50,282,500	
令和３年度第１回熊本県公募公債（５年）	200,000,000	199,686,000	
平成２５年度第１回浜松市公募公債	161,000,000	163,368,310	
第５回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	115,243,000	
第１５回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	116,646,000	
平成２６年度第７回大阪市公募公債	100,000,000	101,474,000	
第１回名古屋市公募公債（２０年）	200,000,000	207,384,000	
第１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	126,629,000	
第９回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	113,047,000	
第９回名古屋市公募公債（３０年）	90,000,000	114,365,700	
第２８回名古屋市公募公債（５年）	500,000,000	499,710,000	
第４９１回名古屋市公募公債	400,000,000	407,616,000	

	第１回京都市公募公債（１５年）	100,000,000	104,741,000	
	第３回京都市公募公債（２０年）	100,000,000	107,969,000	
	第５回京都市公募公債（２０年）	50,000,000	55,586,500	
	平成１８年度第３回神戸市公募公債（２０年）	110,000,000	121,999,900	
	平成２０年度第２４回神戸市公募公債（２０年）	200,000,000	226,230,000	
	平成２２年度第４回神戸市公募公債	100,000,000	114,181,000	
	第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	107,229,000	
	第７回横浜市公募公債（２０年）	450,000,000	485,343,000	
	平成２７年度第２回横浜市公募公債	200,000,000	203,672,000	
	平成２７年度第３回横浜市公募公債	400,000,000	407,112,000	
	平成２７年度第４回横浜市公募公債	300,000,000	305,118,000	
	第２７回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	113,740,000	
	第３３回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	97,915,000	
	第３５回横浜市公募公債（２０年）	500,000,000	496,420,000	
	第５４回横浜市公募公債（５年）	300,000,000	299,946,000	
	平成２２年度第８回札幌市公募公債（３０年）	80,000,000	103,039,200	
	平成２３年度第３回札幌市公募公債	100,000,000	115,780,000	
	令和元年度第２回札幌市公募公債（５年）	600,000,000	600,000,000	
	令和２年度第７回札幌市公募公債	200,000,000	197,914,000	
	令和３年度第２回札幌市公募公債（５年）	100,000,000	99,891,000	
	第７回川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	114,071,000	
	第６２回川崎市公募公債（５年）	490,000,000	489,230,700	
	第１７回北九州市公募公債（２０年）	100,000,000	113,440,000	
	平成２５年度第３回北九州市公募公債	100,000,000	101,349,000	
	平成２５年度第４回福岡市公募公債	50,000,000	50,572,500	
	平成３０年度第１１回福岡市公募公債（５年）	100,000,000	100,021,000	
	平成２５年度第２回広島市公募公債	100,000,000	101,336,000	
	平成２６年度第４回福井県公募公債	100,000,000	101,300,000	
	平成２８年度第１回山梨県公募公債	200,000,000	200,094,000	
	平成３０年度第１回山梨県公募公債	100,000,000	100,925,000	
	第４回京都市保証京都市土地開発公社債券	200,000,000	199,738,000	
	第９６回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	100,000,000	113,494,000	
地方債証券 合計		34,545,950,000	35,904,956,908	
特殊債券	第４回政府保証新関西国際空港債券	104,000,000	105,700,400	
	第６回神奈川県住宅供給公社債券	100,000,000	98,981,000	
	第１９回政府保証日本政策投資銀行	100,000,000	100,755,000	
	第２２回政府保証日本政策投資銀行	20,000,000	20,264,800	
	第２６回政府保証日本政策投資銀行	100,000,000	101,355,000	
	第３６回日本政策投資銀行債券（財投機関債）	30,000,000	33,387,300	
	第１回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	146,467,000	

第８回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	140,000,000	153,906,200	
第１７回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	300,000,000	331,818,000	
第１８回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	30,000,000	43,590,300	
第１９回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	285,588,000	
第２０回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	222,658,000	
第２２回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	110,000,000	155,039,500	
第２３回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	300,000,000	337,305,000	
第２７回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	225,256,000	
第２８回道路債券（財投機関債）	100,000,000	127,671,000	
第３３回道路債券（財投機関債）	300,000,000	388,527,000	
第３８回道路債券（財投機関債）	200,000,000	211,710,000	
第４２回道路債券（財投機関債）	200,000,000	213,706,000	
第８３回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	150,000,000	173,463,000	
第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	114,613,000	
第１０１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	128,693,000	
第１０６回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	400,000,000	404,572,000	
第１０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	127,176,000	
第１１０回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	101,267,000	
第１１６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,394,000	
第１１８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,590,000	
第１２１回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	101,264,000	
第１４５回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	114,861,000	
第１４８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,830,000	
第１５０回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	300,000,000	324,972,000	
第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	127,627,000	
第１５８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	124,957,000	
第１６０回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	110,349,000	
第１６２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,653,000	

第１６５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,925,000	
第１８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	30,000,000	30,264,900	
第１８６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	170,700,000	171,995,613	
第１８９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	153,000,000	154,044,990	
第１９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	340,000,000	342,777,800	
第１９３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,254,000	
第１９５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	323,000,000	327,438,020	
第２００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	308,000,000	312,151,840	
第２０７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	208,000,000	210,795,520	
第２１３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,399,000	
第２１５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,510,000	
第２２０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,560,000	
第２２２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	124,000,000	125,874,880	
第２２６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,113,000	
第２３１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	483,000,000	489,853,770	
第２３４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,376,000	
第２４１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,864,000	
第２４７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	133,000,000	135,261,000	
第２４９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	102,674,580	
第２５１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,955,000	
第２６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,272,000	
第２６９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,134,000	
第１回地方公共団体金融機構債券（２０年）（財投機関債）	50,000,000	57,581,500	
第３回公営企業債券（２０年）（財投機関債）	120,000,000	121,368,000	
第４回公営企業債券（３０年）（財投機関債）	100,000,000	129,874,000	
第６回公営企業債券（２０年）（財投機関債）	100,000,000	103,766,000	
第７回公営企業債券（２０年）（財投機関債）	100,000,000	104,637,000	
第８回公営企業債券（２０年）（財投機関債）	100,000,000	104,743,000	

第９回公営企業債券（２０年）（財投機関債）	50,000,000	53,046,000	
第１１回地方公共団体金融機構債券（２０年）（財投機関債）	100,000,000	113,858,000	
第１２回公営企業債券（２０年）（財投機関債）	300,000,000	318,831,000	
第１３回地方公共団体金融機構債券（２０年）（財投機関債）	100,000,000	116,618,000	
第１４回地方公共団体金融機構債券（２０年）（財投機関債）	80,000,000	94,006,400	
第１６回地方公共団体金融機構債券（２０年）（財投機関債）	80,000,000	91,784,800	
第１７回公営企業債券（２０年）（財投機関債）	150,000,000	164,578,500	
第２３回地方公共団体金融機構債券（２０年）（財投機関債）	100,000,000	113,775,000	
第２４回公営企業債券（２０年）（財投機関債）	100,000,000	113,203,000	
Ｆ２４回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	70,000,000	71,292,200	
第２７回地方公共団体金融機構債券（２０年）（財投機関債）	50,000,000	57,630,000	
第４４回地方公共団体金融機構債券（２０年）（財投機関債）	100,000,000	110,627,000	
第４６回政府保証地方公共団体金融機構債券	17,000,000	17,129,030	
第４７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,672,000	
第４７回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	200,000,000	201,378,000	
第４８回政府保証地方公共団体金融機構債券	36,000,000	36,285,120	
第５１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,295,000	
Ｆ５４回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	200,000,000	206,656,000	
第５４回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	200,000,000	202,596,000	
第５５回政府保証地方公共団体金融機構債券	465,000,000	471,156,600	
第５８回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,122,000	
第５９回政府保証地方公共団体金融機構債券	315,000,000	319,652,550	
第６０回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	200,000,000	203,308,000	
第６１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,535,000	
第６４回政府保証地方公共団体金融機構債券	240,000,000	243,446,400	
第７３回政府保証地方公共団体金融機構債券	302,000,000	306,937,700	
第７７回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	300,000,000	305,202,000	
第７８回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	152,155,500	
第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	674,000,000	674,411,140	
第８３回政府保証地方公共団体金融機構債券	102,000,000	102,063,240	
Ｆ９０回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	108,797,000	
第１００回政府保証地方公共団体金融機構債券	225,000,000	225,123,750	
Ｆ１０４回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	103,982,000	
Ｆ１３１回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	70,000,000	78,214,500	
Ｆ１５１回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	107,064,000	
Ｆ２０３回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	200,000,000	211,024,000	

Ｆ２３４回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	114,550,000	
第２７回首都高速道路	100,000,000	100,038,000	
第２４回阪神高速道路	200,000,000	199,942,000	
第１０回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	92,446,400	
第１５回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	91,460,800	
第５回本州四国連絡橋債券（財投機関債）	200,000,000	212,512,000	
第１６回政府保証民間都市開発債券	90,000,000	91,099,800	
第４８回福祉医療機構債券（財投機関債）	400,000,000	402,324,000	
第５４回福祉医療機構債券（財投機関債）	100,000,000	100,441,000	
第４回中部国際空港（財投機関債）	200,000,000	201,802,000	
第１８回政府保証中部国際空港債券	200,000,000	201,538,000	
第２３２回政府保証預金保険機構債券	400,000,000	401,256,000	
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,214,000	32,579,306	
第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,071,000	11,237,950	
第２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,255,000	37,094,303	
第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,233,000	11,440,136	
第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	48,421,000	48,246,200	
第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	51,906,000	51,757,548	
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,099,000	11,284,686	
第４回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	61,965,000	61,648,978	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	19,936,000	19,996,206	
第６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,978,000	11,179,665	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,996,000	12,258,232	
第７回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	40,132,000	40,251,593	
第８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,120,000	23,559,511	
第８回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	81,615,000	81,247,732	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	10,636,000	10,751,826	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,730,000	13,158,873	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	10,995,000	11,151,898	
第１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,696,000	25,360,075	
第１６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	26,997,000	27,050,184	
第１７回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	27,096,000	27,153,443	
第１８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	8,979,000	8,995,611	
第１９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,668,000	19,707,336	
第２０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,819,000	9,844,136	
第２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,781,000	24,216,430	
第３１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,671,000	10,760,422	
第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,995,000	24,395,395	
第３２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,804,000	23,096,347	
第３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,049,000	24,366,941	
第３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,638,000	23,939,911	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,986,000	46,272,832	

第３７回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,539,000	11,742,432	
第３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,988,000	47,308,930	
第３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,547,000	25,775,086	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	33,297,000	33,769,151	
第４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,098,000	50,001,718	
第４１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,843,000	12,119,534	
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,088,000	32,489,420	
第４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,887,000	29,382,022	
第４４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,718,000	22,124,343	
第４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	107,248,000	113,350,411	
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,641,000	71,136,010	
第４７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,399,000	21,449,140	
第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,178,000	44,311,363	
第４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,662,000	44,725,560	
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,824,000	46,852,734	
第５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,875,000	11,015,287	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,018,000	49,201,045	
第５２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	24,428,000	25,125,663	
第５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,022,000	53,341,460	
第５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,726,000	56,183,964	
第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,402,000	32,848,376	
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,273,000	33,788,217	
第５９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,994,000	73,506,998	
第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,410,000	75,764,031	
第６１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,708,000	73,762,585	
第６２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,091,000	39,695,773	
第６３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,100,000	39,552,753	
第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	120,384,000	125,121,110	
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,360,000	37,974,020	
第７４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,033,000	43,060,850	
第７６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,230,000	36,715,296	
第７７回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	30,000,000	32,241,900	
第７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,197,000	37,526,515	
第８１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,327,000	41,826,357	
第８３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,761,000	44,304,244	
第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,148,000	173,981,054	
第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,562,000	89,617,638	
第８８回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	114,902,000	
第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,539,000	48,025,455	
第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	143,922,000	147,938,863	
第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,282,000	51,336,916	

第９３回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	200,000,000	214,560,000	
第９５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,613,000	64,189,595	
第９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,806,000	61,069,700	
第９８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,319,000	63,161,635	
第１００回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	200,000,000	231,128,000	
第１０２回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	106,871,000	
第１０３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,523,000	66,325,772	
第１０６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	134,586,000	135,746,131	
第１０９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	293,560,000	292,876,005	
第１１１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	225,093,000	222,225,315	
第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	155,704,000	156,225,608	
第１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	542,374,000	544,809,259	
第１２１回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	130,000,000	166,203,700	
第１２２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	238,605,000	239,273,094	
第１２３回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	114,900,000	
第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,117,000	80,207,532	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,750,000	81,700,950	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,708,000	80,783,865	
第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,848,000	165,380,459	
第１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,214,000	164,370,003	
第１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,248,000	82,189,603	
第１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,224,000	82,191,932	
第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	249,342,000	249,566,407	
第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,589,000	83,524,636	
第１３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,753,000	84,960,644	
第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	170,604,000	171,303,476	
第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,818,000	170,877,664	
第１４３回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	106,768,000	
第１４７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,030,000	175,428,981	
第１４９回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	200,000,000	202,884,000	
第１５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	272,103,000	268,007,849	
第１５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,302,000	181,173,863	
第１５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,673,000	91,104,627	
第１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,720,000	94,366,694	
第１６１回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	103,350,000	
第１６２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,492,000	190,524,965	
第１６４回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	101,745,000	

	第１６５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,455,000	96,010,342	
	第１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	291,729,000	291,233,060	
	第１６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,794,000	195,267,314	
	第１７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,500,000	195,466,410	
	第１７１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,280,000	195,368,356	
	第１７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,821,000	97,848,601	
	第１７４回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	180,000,000	194,977,800	
	第１７５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,861,000	99,275,814	
	第１７６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	198,068,000	
	第１７７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	199,412,000	
	第１９４回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	100,117,000	
	第２０３回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	100,814,000	
	第２３１回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	100,066,000	
	第６回沖縄振興開発金融公庫債券（財投機関債）	50,000,000	53,395,500	
	い第８１４号商工債券	200,000,000	200,282,000	
	い第８３２号商工債券	100,000,000	99,971,000	
	い第８４３号商工債券	200,000,000	200,288,000	
	い第８４８号商工債券	100,000,000	100,039,000	
	い第８５０号商工債券	300,000,000	300,000,000	
	い第８５４号商工債券	400,000,000	399,644,000	
	い第８１８号農林債券	200,000,000	200,160,000	
	第３４１回信金中金債	100,000,000	100,090,000	
	第３７６回信金中金債	100,000,000	99,979,000	
	第１１号商工債券（１０年）	300,000,000	304,614,000	
	第２５７号商工債券（３年）	200,000,000	199,880,000	
	第２回信金中金債（１０年）	100,000,000	101,689,000	
	第７回国際協力機構債券（財投機関債）	70,000,000	81,018,000	
	第８３回東日本高速道路	400,000,000	399,824,000	
	第７８回中日本高速道路	300,000,000	300,135,000	
	第２９回西日本高速道路	200,000,000	202,002,000	
	第５６回西日本高速道路	900,000,000	900,351,000	
	第６１回西日本高速道路	400,000,000	399,648,000	
	第７２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	105,335,000	
特殊債券 合計		32,675,088,000	34,091,442,434	
社債券	第１９回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	102,169,000	
	第２６回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	100,229,000	
	第２９回フランス相互信用連合銀行	200,000,000	199,276,000	
	第３５回フランス相互信用連合銀行	500,000,000	497,870,000	
	第１７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	200,000,000	199,882,000	

第１回サンタンデール銀行（２０１９）	500,000,000	500,330,000	
第１２回新関西国際空港	100,000,000	106,424,000	
第３２回成田国際空港	100,000,000	100,310,000	
第１７回ナショナル・オーストラリア銀行	100,000,000	100,124,000	
第１回国際石油開発帝石	100,000,000	99,689,000	
第２１回大和ハウス工業	300,000,000	299,490,000	
第１０回明治ホールディングス（サステナビリティ）	200,000,000	198,694,000	
第１６回アサヒグループホールディングス	100,000,000	99,487,000	
第５回サントリー食品インターナショナル	200,000,000	199,226,000	
第２２回味の素	100,000,000	100,544,000	
第３回　キユーピー	100,000,000	99,836,000	
第１３回日本たばこ産業	200,000,000	199,934,000	
第６回ヒューリック	400,000,000	399,780,000	
第４回トヨタ紡織	200,000,000	199,570,000	
第１１回帝人	100,000,000	99,718,000	
第９回クラレ	100,000,000	100,162,000	
第１６回旭化成	200,000,000	199,444,000	
第４２回王子ホールディングス	300,000,000	298,449,000	
第１１回イビデン	200,000,000	199,354,000	
第４回野村総合研究所	100,000,000	100,168,000	
第６回花王	200,000,000	199,528,000	
第１９回オリエンタルランド	300,000,000	299,115,000	
第６回ヤフー	100,000,000	99,886,000	
第１９回Ｚホールディングス	200,000,000	198,846,000	
第５回荒川化学工業（サステナビリティ）	100,000,000	99,445,000	
第１１回ブリヂストン	300,000,000	299,640,000	
第１２回日本電気硝子	100,000,000	99,396,000	
第４回新日本製鐵	200,000,000	199,962,000	
第１９回日立製作所	100,000,000	99,322,000	
第１８回デンソー	300,000,000	299,820,000	
第１８回ＪＡ三井リース	100,000,000	99,590,000	
第１０回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	100,000,000	99,447,000	
第２６回トヨタ自動車（サステナビリティ）	800,000,000	797,544,000	
第１回明治安田生命２０１８基金	200,000,000	200,170,000	
第１回明治安田生命２０１９基金	200,000,000	199,992,000	
第５１回住友商事	100,000,000	105,984,000	
第１回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	100,000,000	101,364,000	
第３回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	300,000,000	303,039,000	
第１７回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	500,000,000	500,850,000	
第２３回三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付	200,000,000	235,682,000	
第２６回三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付	200,000,000	211,490,000	

第２９回三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付	200,000,000	213,856,000	
第３０回三菱東京ＵＦＪ銀行（劣後特約付）	100,000,000	116,095,000	
第８８回三菱東京ＵＦＪ銀行	100,000,000	111,064,000	
第１５回みずほフィナンシャルグループ劣後特約付	100,000,000	99,864,000	
第１８回みずほ銀行（劣後特約付）	100,000,000	107,257,000	
第２８回芙蓉総合リース	500,000,000	497,270,000	
第１６回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	1,200,000,000	1,201,104,000	
第１７回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	300,000,000	300,498,000	
第２０回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス（グリーン）	600,000,000	597,966,000	
第６５回ホンダファイナンス	300,000,000	299,616,000	
第７０回ホンダファイナンス	200,000,000	199,452,000	
第７２回ホンダファイナンス	400,000,000	398,852,000	
第９５回トヨタファイナンス	500,000,000	499,025,000	
第９６回トヨタファイナンス	800,000,000	797,496,000	
第９７回トヨタファイナンス	200,000,000	199,512,000	
第３１回リコーリース	100,000,000	100,249,000	
第４１回リコーリース	500,000,000	497,485,000	
第７９回アコム	300,000,000	300,180,000	
第８０回アコム	200,000,000	199,790,000	
第８１回アコム	100,000,000	99,293,000	
第４７回日立キャピタル	100,000,000	100,865,000	
第８７回日立キャピタル	300,000,000	299,544,000	
第２０１回オリックス	500,000,000	496,540,000	
第２１回三井住友ファイナンス＆リース	300,000,000	300,255,000	
第３０回三井住友ファイナンス＆リース	200,000,000	199,678,000	
第１回三菱ＨＣキャピタル	900,000,000	896,715,000	
第６９回三菱ＵＦＪリース	500,000,000	499,850,000	
第２４回野村ホールディングス	100,000,000	106,583,000	
第２７回野村ホールディングス	100,000,000	106,272,000	
第１３７回三菱地所	300,000,000	299,910,000	
第１２回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	100,000,000	101,275,000	
第３６回京王電鉄	200,000,000	200,718,000	
第３４回東日本旅客鉄道	100,000,000	105,669,000	
第５３回東日本旅客鉄道	300,000,000	338,256,000	
第１００回東日本旅客鉄道	200,000,000	242,552,000	
第１０２回東日本旅客鉄道	100,000,000	101,225,000	
第１６３回東日本旅客鉄道	600,000,000	596,634,000	
第１７４回東日本旅客鉄道	700,000,000	697,144,000	
第７３回西日本旅客鉄道	400,000,000	397,744,000	
第４２回東海旅客鉄道	100,000,000	114,115,000	
第５３回東海旅客鉄道	100,000,000	112,233,000	
第８３回東海旅客鉄道	400,000,000	399,400,000	

第２回東京地下鉄	500,000,000	526,155,000	
第２８回東京地下鉄	300,000,000	299,628,000	
第５０回阪急阪神ホールディングス	200,000,000	200,488,000	
第５８回阪急阪神ホールディングス	200,000,000	199,146,000	
第６４回名古屋鉄道	200,000,000	198,806,000	
第８回ニッコンホールディングス	100,000,000	99,777,000	
第９回九州旅客鉄道	200,000,000	199,466,000	
第１１回ソフトバンク	200,000,000	199,180,000	
第１４回ソフトバンク	200,000,000	198,422,000	
第５４８回東京電力	100,000,000	111,335,000	
第５６７回東京電力	100,000,000	109,972,000	
第４９９回中部電力	100,000,000	101,484,000	
第５０８回関西電力	200,000,000	201,742,000	
第５１０回関西電力	500,000,000	505,365,000	
第５１８回関西電力	200,000,000	200,682,000	
第５２４回関西電力	200,000,000	201,490,000	
第５３２回関西電力	100,000,000	100,011,000	
第５４３回関西電力	200,000,000	199,004,000	
第３８１回中国電力	100,000,000	101,780,000	
第３８５回中国電力	100,000,000	101,815,000	
第３９３回中国電力	100,000,000	99,976,000	
第４００回中国電力	200,000,000	200,442,000	
第４０９回中国電力	200,000,000	200,646,000	
第３０４回北陸電力	100,000,000	101,459,000	
第３０７回北陸電力	100,000,000	103,598,000	
第３２２回北陸電力	100,000,000	100,476,000	
第４８５回東北電力	100,000,000	100,022,000	
第４９４回東北電力	200,000,000	201,428,000	
第５２９回東北電力	500,000,000	496,665,000	
第４４９回九州電力	300,000,000	301,689,000	
第４６８回九州電力	100,000,000	100,319,000	
第４７１回九州電力	300,000,000	301,188,000	
第４８２回九州電力	300,000,000	299,916,000	
第４８４回九州電力	400,000,000	398,488,000	
第４９３回九州電力	400,000,000	397,620,000	
第２９回沖縄電力	200,000,000	199,600,000	
第５０回電源開発	200,000,000	200,916,000	
第５７回電源開発	100,000,000	99,766,000	
第６４回電源開発	600,000,000	599,460,000	
第６７回電源開発	200,000,000	197,220,000	
第６回東京電力パワーグリッド	100,000,000	102,338,000	
第１３回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101,702,000	

	第１５回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101,781,000	
	第１６回東京電力パワーグリッド	200,000,000	201,988,000	
	第２８回東京電力パワーグリッド	400,000,000	412,440,000	
	第３１回東京電力パワーグリッド	300,000,000	308,508,000	
	第３３回東京電力パワーグリッド	200,000,000	203,100,000	
	第３５回東京電力パワーグリッド	100,000,000	104,341,000	
	第３８回東京電力パワーグリッド	400,000,000	404,076,000	
	第３９回東京電力パワーグリッド	400,000,000	413,840,000	
	第４１回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101,368,000	
	第４４回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,305,000	
	第４７回東京電力パワーグリッド	200,000,000	198,812,000	
	第１回東京電力リニューアブルパワー（グリーン）	200,000,000	199,762,000	
	第１３回広島ガス	200,000,000	199,650,000	
	第７回ファーストリテイリング	100,000,000	100,545,000	
社債券 合計		34,800,000,000	35,110,570,000	
合計		624,865,038,000	652,055,991,072	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

先進国高格付国債マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	［令和 4年 2月 7日現在］
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,302,605,172
国債証券	91,811,213,974
未収利息	586,130,876
前払費用	20,229,148
流動資産合計	97,720,179,170
資産合計	97,720,179,170
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,460,727,103
未払解約金	201,000,000
未払利息	2,369
流動負債合計	1,661,729,472
負債合計	1,661,729,472
純資産の部	
元本等	

	［令和 4年 2月 7日現在］
元本	86,831,686,989
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	9,226,762,709
元本等合計	96,058,449,698
純資産合計	96,058,449,698
負債純資産合計	97,720,179,170

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礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第６０条および第６１条にしたがって処理しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 4年 2月 7日現在]
１． 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	83,694,364,368円
期中追加設定元本額	13,888,423,898円
期中一部解約元本額	10,751,101,277円
元本の内訳※	
国内債券セレクション（ラップ向け）	685,139,559円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定型）	17,020,106円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定成長型）	18,569,426円
先進国高格付国債ファンド（ラップ向け）	7,867,836円
ＭＵＡＭ　先進国高格付国債ファンド（適格機関投資家転売制限付）	47,112,459,885円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１６－０９（適格機関投資家転売制限付）	1,181,336,653円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１６－１０（適格機関投資家転売制限付）	843,820,511円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１６－１１（適格機関投資家転売制限付）	863,967,058円

	[令和 4年 2月 7日現在]
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１６－１２（適格機関投資家転売制限付）	1,874,323,547円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１７－０３（適格機関投資家転売制限付）	1,127,934,021円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１７－０５（適格機関投資家転売制限付）	5,392,448,172円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１７－０７（適格機関投資家転売制限付）	2,893,481,836円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１７－０９（適格機関投資家転売制限付）	2,503,732,513円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１７－１１（適格機関投資家転売制限付）	4,241,563,196円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１８－０１（適格機関投資家転売制限付）	4,495,687,002円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１８－０３（適格機関投資家転売制限付）	3,887,221,389円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１８－０６（適格機関投資家転売制限付）	2,172,831,128円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１８－０７（適格機関投資家転売制限付）	560,956,134円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１８－０９（適格機関投資家転売制限付）	4,088,546,392円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１８－１０（適格機関投資家転売制限付）	1,140,644,810円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１８－１１（適格機関投資家転売制限付）	436,247,120円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１８－１２（適格機関投資家転売制限付）	346,124,622円
ＭＵＫＡＭ　先進国高格付国債ファンド２０１９－０３（適格機関投資家転売制限付）	939,764,073円
合計	86,831,686,989円
２．　受益権の総数	86,831,686,989口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

１　金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第２条第４項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。

区分	自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。 当ファンドは、ファンドの運用の指図に関する権限を再委託しております。この場合、再委託先で投資リスクに対する管理体制を構築しているほか、当該再委託先のリスクの管理体制や管理状況の確認を委託会社で行っております。

2　金融商品の時価等に関する事項

区分	［令和 4年 2月 7日現在］
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	（1）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （2）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

	［令和 4年 2月 7日現在］

種類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△1,418,979,096
合計	△1,418,979,096

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

［令和 4年 2月 7日現在］

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	オーストラリアドル	805,199,712	—	791,947,855	△13,251,857
	売建				
	オーストラリアドル	54,172,248,078	—	54,656,217,281	△483,969,203
	シンガポールドル	36,684,817,335	—	37,648,323,378	△963,506,043
合計		91,662,265,125	—	93,096,488,514	△1,460,727,103

（注）時価の算定方法

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

①為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

②当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	［令和 4年 2月 7日現在］
1口当たり純資産額	1.1063円
(1万口当たり純資産額)	(11,063円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨	種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
オーストラリアドル	国債証券	0.25 AUST GOVT 251121	115,000,000.00	109,650,011.40	
		0.5 AUST GOVT 260921	120,000,000.00	114,069,944.40	
		2.25 AUST GOVT 280521	83,000,000.00	85,420,603.70	
		2.5 AUST GOVT 300521	109,200,000.00	114,373,524.72	
		3.25 AUST GOVT 290421	97,000,000.00	106,324,668.20	
		4.75 AUST GOVT 270421	117,000,000.00	135,025,698.60	
オーストラリアドル合計			641,200,000.00	664,864,451.02 (54,186,452,758)	
シンガポールドル	国債証券	2.625 SINGAPORGOV 280501	111,000,000.00	117,182,700.00	
		2.875 SINGAPORGOV 290701	142,000,000.00	153,076,000.00	
		2.875SINGAPORGOVT 300901	62,000,000.00	67,363,000.00	
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	93,000,000.00	101,509,500.00	
シンガポールドル合計			408,000,000.00	439,131,200.00 (37,624,761,216)	
合計				91,811,213,974 (91,811,213,974)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の(　)内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
オーストラリアドル	国債証券　6銘柄	100.00%	59.02%
シンガポールドル	国債証券　4銘柄	100.00%	40.98%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

ＭＵＡＭ　ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	［令和 4年 2月 7日現在］
資産の部	
流動資産	
預金	2,304,147,222
コール・ローン	1,885,127,292
国債証券	145,311,096,933
派生商品評価勘定	10,362,744
未収入金	18,776,614,016
未収利息	385,755,559
前払費用	98,318,714
流動資産合計	168,771,422,480
資産合計	168,771,422,480
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,660,539,950
未払金	19,430,211,634
未払解約金	67,280,666
未払利息	842
流動負債合計	21,158,033,092
負債合計	21,158,033,092
純資産の部	
元本等	
元本	87,386,070,474
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	60,227,318,914
元本等合計	147,613,389,388
純資産合計	147,613,389,388
負債純資産合計	168,771,422,480

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礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第６０条および第６１条にしたがって処理しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 4年 2月 7日現在]
１．　期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	99,382,959,964円
期中追加設定元本額	11,135,036,646円
期中一部解約元本額	23,131,926,136円
元本の内訳※	
国内債券セレクション（ラップ向け）	1,602,673,106円
三菱ＵＦＪ　ヘッジ付外国債券オープン	53,954,173,222円
ＭＵＡＭ　ヘッジ付外国債券オープンⅡ（適格機関投資家限定）	5,444,704,273円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	22,432,009,129円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　２０型（適格機関投資家限定）	758,586,860円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　４０型（適格機関投資家限定）	1,886,416,332円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　５０型（適格機関投資家限定）	818,182,183円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　３０型（適格機関投資家限定）	5,308,041円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	405,472,452円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	35,230,330円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	43,314,546円
合計	87,386,070,474円
２．　受益権の総数	87,386,070,474口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

１　金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第２条第４項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。

区分	自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2　金融商品の時価等に関する事項

区分	［令和 4年 2月 7日現在］
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	（1）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （2）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	［令和 4年 2月 7日現在］
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△5,637,868,960

合計	△5,637,868,960

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）
取引の時価等に関する事項

通貨関連

［令和 4年 2月 7日現在］

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカドル	64,684,171,500	—	65,114,269,110	△430,097,610
	オーストラリアドル	9,730,588,056	—	9,721,164,936	9,423,120
	イギリスポンド	9,472,282,165	—	9,502,245,185	△29,963,020
	ポーランドズロチ	698,916,200	—	708,364,432	△9,448,232
	中国元	1,021,757,776	—	1,020,880,800	876,976
	ユーロ	60,627,293,784	—	61,818,262,224	△1,190,968,440
合計		146,235,009,481	—	147,885,186,687	△1,650,177,206

（注）時価の算定方法

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

①為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

②当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	［令和 4年 2月 7日現在］
1口当たり純資産額	1.6892円
(1万口当たり純資産額)	(16,892円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨	種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
アメリカドル	国債証券	0.125 T-NOTE 230831	39,400,000.00	38,753,593.75	
		0.125 T-NOTE 230915	100,000.00	98,277.34	
		0.125 T-NOTE 231215	26,400,000.00	25,840,031.23	
		0.25 T-NOTE 230615	27,400,000.00	27,081,046.87	
		0.25 T-NOTE 250731	63,600,000.00	60,593,906.24	
		0.375 T-NOTE 240915	46,800,000.00	45,487,406.25	
		0.5 T-NOTE 270531	23,100,000.00	21,569,625.00	
		0.625 T-NOTE 300515	47,600,000.00	42,962,718.74	
		0.75 T-NOTE 260831	40,000,000.00	38,221,874.99	
		1.25 T-BOND 500515	44,600,000.00	35,274,070.28	
		1.25 T-NOTE 280331	61,400,000.00	59,126,281.25	
		1.25 T-NOTE 310815	3,200,000.00	3,013,500.00	
		1.375 T-BOND 401115	113,900,000.00	97,909,507.80	
		1.375 T-NOTE 230215	700,000.00	703,226.56	
		1.375 T-NOTE 250131	16,900,000.00	16,808,898.43	
		1.375 T-NOTE 311115	1,500,000.00	1,426,289.06	
		1.5 T-NOTE 270131	9,200,000.00	9,075,296.87	
		1.875 T-BOND 511115	7,900,000.00	7,290,218.75	
		2 T-BOND 411115	17,600,000.00	16,783,250.00	
		3.125 T-NOTE 281115	7,400,000.00	7,976,968.75	
アメリカドル合計			598,700,000.00	555,995,988.16 (64,084,097,595)	
オーストラリアドル	国債証券	1 AUST GOVT 311121	39,600,000.00	36,290,715.91	
		2.25 AUST GOVT 280521	35,200,000.00	36,226,569.28	
		2.5 AUST GOVT 300521	44,900,000.00	47,027,209.34	
オーストラリアドル合計			119,700,000.00	119,544,494.53 (9,742,876,304)	
イギリスポンド	国債証券	0.125 GILT 230131	2,900,000.00	2,871,493.00	
		0.125 GILT 240131	3,300,000.00	3,227,272.62	
		0.125 GILT 280131	3,600,000.00	3,363,300.00	
		0.375 GILT 301022	4,100,000.00	3,771,406.32	

		0.625 GILT 250607	3,000,000.00	2,941,350.00	
		0.625 GILT 501022	11,200,000.00	8,979,824.00	
		1.125 GILT 390131	600,000.00	561,660.00	
		1.25 GILT 270722	500,000.00	499,740.00	
		1.25 GILT 411022	32,600,000.00	30,872,200.00	
		1.5 GILT 260722	2,200,000.00	2,225,452.90	
		6 GILT 281207	700,000.00	915,076.26	
イギリスポンド合計			64,700,000.00	60,228,775.10 (9,395,086,627)	
ポーランドズロチ	国債証券	0.75 POLAND 250425	21,900,000.00	19,988,122.77	
		1.25 POLAND 301025	5,900,000.00	4,814,227.24	
ポーランドズロチ合計			27,800,000.00	24,802,350.01 (717,197,154)	
中国元	国債証券	2.91 CHINA GOVT 281014	16,000,000.00	16,250,598.40	
		3.01 CHINA GOVT 280513	39,000,000.00	39,882,527.10	
中国元合計			55,000,000.00	56,133,125.50 (1,017,424,126)	
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 240715	9,710,000.00	9,749,846.92	
		0 AUSTRIA GOVT 250420	4,800,000.00	4,799,611.20	
		0 AUSTRIA GOVT 310220	7,440,000.00	7,113,320.76	
		0 BEL GOVT 311022	1,200,000.00	1,134,852.00	
		0 BUND 260815	1,100,000.00	1,101,625.80	
		0 BUND 271115	16,050,000.00	16,007,050.20	
		0 BUND 290815	1,100,000.00	1,093,143.70	
		0 BUND 310215	16,250,000.00	16,039,906.83	
		0 BUND 360515	18,690,000.00	17,922,325.24	
		0 FINNISH GOVT 300915	2,360,000.00	2,278,485.26	
		0 ITALY GOVT 260401	1,200,000.00	1,156,404.93	
		0 NETH GOVT 240115	3,300,000.00	3,318,793.50	
		0 NETH GOVT 290115	2,400,000.00	2,357,388.00	
		0 NETH GOVT 310715	1,200,000.00	1,160,724.00	
		0 NETH GOVT 380115	4,740,000.00	4,381,602.62	
		0 O.A.T 250325	2,970,000.00	2,972,054.94	
		0 O.A.T 260225	14,280,000.00	14,206,229.52	
		0 O.A.T 270225	4,700,000.00	4,640,028.00	
		0 O.A.T 291125	5,800,000.00	5,610,500.95	
		0 O.A.T 301125	2,240,000.00	2,141,260.80	
		0 OBL 250411	5,700,000.00	5,730,886.02	
		0 OBL 260410	3,400,000.00	3,407,647.28	
		0 SCHATS 230915	200,000.00	201,189.02	
		0 SPAIN GOVT 240531	1,300,000.00	1,297,333.70	
		0 SPAIN GOVT 250131	11,520,000.00	11,460,706.56	

		0.1 BEL GOVT 300622	3,580,000.00	3,481,643.32	
		0.2 IRISH GOVT 270515	9,730,000.00	9,695,069.30	
		0.25 FINNISH GOVT 400915	1,140,000.00	1,053,942.54	
		0.25 ITALY GOVT 280315	14,140,000.00	13,343,146.94	
		0.3 ITALY GOVT 230815	80,000.00	80,317.68	
		0.4 BEL GOVT 400622	2,470,000.00	2,257,283.60	
		0.4 IRISH GOVT 350515	1,290,000.00	1,230,890.91	
		0.5 BUND 250215	550,000.00	561,706.20	
		0.5 BUND 260215	1,100,000.00	1,124,796.20	
		0.5 BUND 270815	2,700,000.00	2,769,903.00	
		0.5 NETH GOVT 260715	4,580,000.00	4,669,351.22	
		0.5 O.A.T 290525	10,200,000.00	10,282,354.80	
		0.5 O.A.T 400525	35,350,000.00	33,030,610.48	
		0.5 SPAIN GOVT 300430	9,900,000.00	9,648,837.00	
		0.55 IRISH GOVT 410422	700,000.00	657,046.36	
		0.6 ITALY GOVT 230615	14,850,000.00	14,983,828.20	
		0.75 NETH GOVT 280715	2,300,000.00	2,385,339.20	
		0.8 SPAIN GOVT 270730	4,400,000.00	4,454,916.40	
		0.85 AUSTRIA GOVT 200630	610,000.00	485,696.64	
		0.875 FINNISH GOV 250915	1,200,000.00	1,239,886.80	
		0.9 BEL GOVT 290622	1,100,000.00	1,143,044.10	
		0.95 ITALY GOVT 370301	1,300,000.00	1,129,735.10	
		1 BEL GOVT 260622	4,400,000.00	4,566,862.08	
		1 O.A.T 270525	4,300,000.00	4,472,344.00	
		1.1 IRISH GOVT 290515	610,000.00	639,304.40	
		1.2 SPAIN GOVT 401031	22,930,000.00	21,843,513.53	
		1.3 SPAIN GOVT 261031	11,960,000.00	12,459,868.20	
		1.35 ITALY GOVT 300401	5,600,000.00	5,551,358.40	
		1.45 ITALY GOVT 250515	100,000.00	102,561.60	
		1.5 O.A.T 500525	3,100,000.00	3,452,525.80	
		1.6 BEL GOVT 470622	4,630,000.00	5,208,759.26	
		1.65 ITALY GOVT 301201	9,800,000.00	9,860,622.80	
		1.7 BEL GOVT 500622	2,750,000.00	3,156,763.22	
		1.75 O.A.T 230525	11,990,000.00	12,334,592.60	
		1.85 ITALY GOVT 250701	3,500,000.00	3,634,321.60	
		1.85 SPAIN GOVT 350730	7,430,000.00	7,974,789.89	
		1.95 SPAIN GOVT 260430	2,100,000.00	2,239,447.14	
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	610,000.00	873,213.53	
		2.2 ITALY GOVT 270601	3,100,000.00	3,283,334.00	
		2.5 BUND 440704	5,960,000.00	8,933,116.20	
		2.625 FINNISH GOV 420704	1,200,000.00	1,661,868.00	
		2.75 NETH GOVT 470115	2,880,000.00	4,475,675.52	

		2.75 O.A.T 271025	1,170,000.00	1,337,707.80	
		2.8 ITALY GOVT 281201	12,200,000.00	13,414,046.40	
		3.1 ITALY GOVT 400301	23,330,000.00	26,984,936.12	
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	790,000.00	1,196,543.48	
		3.4 IRISH GOVT 240318	1,680,000.00	1,808,284.80	
		4.5 O.A.T 410425	9,160,000.00	15,082,636.16	
		5 ITALY GOVT 390801	6,560,000.00	9,435,248.00	
		5.25 ITALY GOVT 291101	3,120,000.00	4,018,893.84	
		5.5 BUND 310104	4,240,000.00	6,304,303.36	
ユーロ合計			438,120,000.00	457,299,705.47 (60,354,415,127)	
合計				145,311,096,933 (145,311,096,933)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の(　)内は、邦貨換算額であります。
(注2)合計金額欄の(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数		組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券	20銘柄	100.00%	44.10%
オーストラリアドル	国債証券	3銘柄	100.00%	6.70%
イギリスポンド	国債証券	11銘柄	100.00%	6.47%
ポーランドズロチ	国債証券	2銘柄	100.00%	0.49%
中国元	国債証券	2銘柄	100.00%	0.70%
ユーロ	国債証券	76銘柄	100.00%	41.53%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

ショートデュレーション円インカムマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

［令和 4年 2月 7日現在］

資産の部
　流動資産

	［令和 4年 2月 7日現在］
預金	232,764,756
コール・ローン	1,733,939,978
国債証券	2,056,005,843
特殊債券	1,095,746,603
社債券	3,664,054,817
派生商品評価勘定	75,787,327
未収利息	36,363,957
前払費用	5,002,638
差入委託証拠金	194,926,449
流動資産合計	9,094,592,368
資産合計	9,094,592,368
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	35,734,033
未払解約金	403
未払利息	774
流動負債合計	35,735,210
負債合計	35,735,210
純資産の部	
元本等	
元本	9,421,507,267
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△362,650,109
元本等合計	9,058,857,158
純資産合計	9,058,857,158
負債純資産合計	9,094,592,368

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 4年 2月 7日現在]
１． 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	7,275,464,134円

	[令和 4年 2月 7日現在]
期中追加設定元本額	4,085,727,813円
期中一部解約元本額	1,939,684,680円
元本の内訳※	
国内債券セレクション（ラップ向け）	8,949,733,665円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定型）	201,604,633円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定成長型）	243,090,633円
ショートデュレーション円インカムオープン（ラップ向け）	27,078,336円
合計	9,421,507,267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。	362,650,109円
３．　受益権の総数	9,421,507,267口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

１　金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第２条第４項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
２.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、債券先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
３.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

２　金融商品の時価等に関する事項

区分	［令和 4年 2月 7日現在］
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
２.時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	［令和 4年 2月 7日現在］ 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△12,944,212
特殊債券	△47,960,694
社債券	△156,347,670
合計	△217,252,576

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）
取引の時価等に関する事項

債券関連
［令和 4年 2月 7日現在］

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	債券先物取引 売建	1,662,988,790	—	1,614,461,246	48,527,544
合計		1,662,988,790	—	1,614,461,246	48,527,544

（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 4年 2月 7日現在］

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカドル	936,038,534	—	940,670,924	△4,632,390
	カナダドル	680,012,578	—	669,965,898	10,046,680
	オーストラリアドル	1,542,290,256	—	1,525,129,632	17,160,624
	イギリスポンド	185,364,515	—	185,312,036	52,479
	スウェーデンクローネ	376,384,500	—	378,000,000	△1,615,500
	ユーロ	1,831,568,963	—	1,861,055,106	△29,486,143
合計		5,551,659,346	—	5,560,133,596	△8,474,250

（注）時価の算定方法

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

①為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

②当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	［令和 4年 2月 7日現在］
1口当たり純資産額	0.9615円
(1万口当たり純資産額)	(9,615円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨	種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
円	国債証券	第４３１回利付国債（２年）	400,000,000	400,432,000	
		第１０３２回国庫短期証券	300,000,000	300,060,600	
		第１０３７回国庫短期証券	350,000,000	350,011,550	
		第１０４３回国庫短期証券	340,000,000	340,111,180	
		第１０５１回国庫短期証券	200,000,000	200,036,600	
	国債証券 小計		1,590,000,000	1,590,651,930	
	社債券	第３４回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101,557,000	
	社債券 小計		100,000,000	101,557,000	
円合計			1,690,000,000	1,692,208,930	
アメリカドル	国債証券	0.125 T-NOTE 221130	1,000,000.00	994,492.18	
	国債証券 小計		1,000,000.00	994,492.18 (114,625,168)	
	特殊債券	1.75 ASIAN DEV 290919	1,200,000.00	1,179,861.66	
	特殊債券 小計		1,200,000.00	1,179,861.66 (135,990,854)	
	社債券	2.512 SUMITOMO MI 250122	1,000,000.00	1,010,894.70	
		3.625 SCENTRE GRO 260128	1,000,000.00	1,040,388.80	
		4.75 VIACOMCBS IN 250515	1,000,000.00	1,072,431.74	
		FRN MACQUARIE B 240327	500,000.00	513,261.00	
		STEP BRITISH TEL 301215	1,000,000.00	1,409,761.02	
	社債券 小計		4,500,000.00	5,046,737.26 (581,686,936)	
アメリカドル合計			6,700,000.00	7,221,091.10 (832,302,958)	
カナダドル	特殊債券	1.5 ASIAN DEV 280504	1,500,000.00	1,443,876.00	
		1.9 IBRD 250116	2,000,000.00	2,008,538.00	
		4.55 EUROFIMA 270330	1,000,000.00	1,107,799.00	
	特殊債券 小計		4,500,000.00	4,560,213.00 (412,243,255)	
	社債券	2.975 WELLS FARGO 260519	1,000,000.00	1,008,422.00	
		FRN GOLDMAN SA 230426	1,000,000.00	1,003,630.00	
	社債券 小計		2,000,000.00	2,012,052.00 (181,889,500)	
			6,500,000.00	6,572,265.00	

カナダドル合計				(594,132,755)	
オーストラリアドル	特殊債券	3.4 ASIAN DEV 270910	1,000,000.00	1,065,162.20	
		4 KFW 250227	1,500,000.00	1,605,012.60	
	特殊債券 小計		2,500,000.00	2,670,174.80 (217,619,246)	
	社債券	1.873 CENTRAL NIP 240926	1,000,000.00	989,428.86	
		3 ING BANK (AUSTR 230907	1,700,000.00	1,748,457.31	
		3.1 VOLKSWAGEN FI 230417	890,000.00	909,328.75	
		3.25 COMMONWEALT 261117	3,000,000.00	3,139,565.10	
		3.45 AT&T INC 230919	2,500,000.00	2,579,846.75	
		3.5 VICINITY CENT 240426	500,000.00	517,561.75	
		3.85 GENERAL MOTO 230221	3,000,000.00	3,077,400.00	
		FRN NATIONAL A 230316	2,000,000.00	2,010,137.80	
	社債券 小計		14,590,000.00	14,971,726.32 (1,220,195,695)	
オーストラリアドル合計			17,090,000.00	17,641,901.12 (1,437,814,941)	
イギリスポンド	社債券	2.125 BAT CAPITAL 250815	1,000,000.00	971,595.00	
イギリスポンド合計			1,000,000.00	971,595.00 (151,559,104)	
スウェーデンクローネ	社債券	0.5 STADSHYPOTEK 260601	14,000,000.00	13,643,458.22	
		1.25 SWEDISH COVE 220615	15,000,000.00	15,074,515.50	
スウェーデンクローネ合計			29,000,000.00	28,717,973.72 (362,133,648)	
ユーロ	国債証券	0.6 ITALY GOVT 310801	1,000,000.00	908,580.59	
		1.75 O.A.T 230525	1,700,000.00	1,748,858.00	
	国債証券 小計		2,700,000.00	2,657,438.59 (350,728,745)	
	特殊債券	0.375 LB BADEN-WU 260729	1,500,000.00	1,463,907.00	
		1.5 KFW 240611	1,000,000.00	1,035,663.00	
	特殊債券 小計		2,500,000.00	2,499,570.00 (329,893,248)	
	社債券	0.163 NATIONAL GR 280120	1,000,000.00	944,376.00	
		0.524 EXXON MOBIL 280626	1,000,000.00	970,155.00	
		0.625 STELLANTIS 270330	1,000,000.00	960,783.00	
		0.75 BAYER AG 270106	1,000,000.00	981,180.00	
		0.75 LVMH MOET HE 250407	1,000,000.00	1,008,518.20	
		1.125 VICINITY CE 291107	1,000,000.00	961,009.00	
		2.519 BP CAPITAL 280407	1,000,000.00	1,079,928.80	
		4.5 STELLANTIS NV 280707	1,000,000.00	1,163,704.00	
	社債券 小計		8,000,000.00	8,069,654.00 (1,065,032,934)	

ユーロ合計	13,200,000.00	13,226,662.59 (1,745,654,927)	
合計		6,815,807,263 (5,123,598,333)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の(　)内は、邦貨換算額であります。
(注2)合計金額欄の(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数		組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券	1銘柄	13.77%	1.68%
	特殊債券	1銘柄	16.34%	2.00%
	社債券	5銘柄	69.89%	8.53%
カナダドル	特殊債券	3銘柄	69.39%	6.05%
	社債券	2銘柄	30.61%	2.67%
オーストラリアドル	特殊債券	2銘柄	15.14%	3.19%
	社債券	8銘柄	84.86%	17.90%
イギリスポンド	社債券	1銘柄	100.00%	2.22%
スウェーデンクローネ	社債券	2銘柄	100.00%	5.31%
ユーロ	国債証券	2銘柄	20.09%	5.15%
	特殊債券	2銘柄	18.90%	4.84%
	社債券	8銘柄	61.01%	15.63%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

三菱ＵＦＪ　国内債券アクティブマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	［令和 4年 2月 7日現在］
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	216,386,409
国債証券	8,013,942,300
社債券	5,100,890,000
未収入金	497,665,000

	［令和 4年 2月 7日現在］
未収利息	28,081,627
前払費用	958,745
流動資産合計	13,857,924,081
資産合計	13,857,924,081
負債の部	
流動負債	
未払解約金	5,544,492
未払利息	96
流動負債合計	5,544,588
負債合計	5,544,588
純資産の部	
元本等	
元本	9,535,550,532
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	4,316,828,961
元本等合計	13,852,379,493
純資産合計	13,852,379,493
負債純資産合計	13,857,924,081

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 4年 2月 7日現在]
１． 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	8,152,581,997円
期中追加設定元本額	2,796,138,860円
期中一部解約元本額	1,413,170,325円
元本の内訳※	
国内債券通貨プラス	690,604,289円
国内債券セレクション（ラップ向け）	5,188,072,252円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定型）	116,036,987円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定成長型）	140,938,640円
三菱ＵＦＪ　日本バランスオープン　株式２０型	538,015,263円
三菱ＵＦＪ　日本バランスオープン　株式４０型	533,430,319円
三菱ＵＦＪ　ライフプラン　２５	457,779,885円
三菱ＵＦＪ　ライフプラン　５０	566,676,085円

	[令和 4年 2月 7日現在]
三菱ＵＦＪ　ライフプラン　７５	174,666,552円
三菱ＵＦＪ　ライフプラン　５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	176,851,682円
三菱ＵＦＪ　世界バランスファンド　２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	22,066,427円
三菱ＵＦＪ　世界バランスファンド　５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	81,599,909円
三菱ＵＦＪ　ライフ・バランスファンド（安定型）	98,061,762円
三菱ＵＦＪ　ライフ・バランスファンド（安定成長型）	48,367,097円
三菱ＵＦＪ　ライフ・バランスファンド（成長型）	23,102,459円
三菱ＵＦＪ　ライフ・バランスファンド（積極型）	35,900,986円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤーファンド　２０３０	14,910,288円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤーファンド　２０４０	10,247,199円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞ライフ・バランスファンド（安定型）	91,634,819円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞ライフ・バランスファンド（安定成長型）	134,738,775円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞ライフ・バランスファンド（成長型）	61,629,526円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞ライフ・バランスファンド（積極型）	57,108,177円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞ターゲット・イヤー　ファンド　２０３０	157,179,831円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞ターゲット・イヤー　ファンド　２０４０	115,931,323円
合計	9,535,550,532円
２．　受益権の総数	9,535,550,532口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

１　金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第２条第４項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
２.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
３.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

２　金融商品の時価等に関する事項

区分	［令和 4年 2月 7日現在］
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
２.時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	［令和 4年 2月 7日現在］
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△180,144,000
社債券	△3,576,000
合計	△183,720,000

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	［令和 4年 2月 7日現在］
1口当たり純資産額	1.4527円
(1万口当たり純資産額)	(14,527円)

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第５回利付国債（４０年）	70,000,000	92,057,700	
	第７回利付国債（４０年）	70,000,000	87,208,100	
	第１０回利付国債（４０年）	80,000,000	81,632,800	
	第１１回利付国債（４０年）	70,000,000	69,223,700	
	第１４回利付国債（４０年）	80,000,000	75,920,000	
	第３５３回利付国債（１０年）	100,000,000	100,307,000	
	第３５４回利付国債（１０年）	190,000,000	190,537,700	
	第３５６回利付国債（１０年）	170,000,000	170,256,700	
	第３５７回利付国債（１０年）	80,000,000	80,062,400	
	第３５９回利付国債（１０年）	50,000,000	49,958,500	
	第３６０回利付国債（１０年）	270,000,000	269,422,200	
	第３６１回利付国債（１０年）	110,000,000	109,613,900	
	第３６３回利付国債（１０年）	330,000,000	327,868,200	
	第２３回利付国債（３０年）	40,000,000	51,618,400	
	第２６回利付国債（３０年）	50,000,000	64,294,000	
	第２８回利付国債（３０年）	20,000,000	26,237,200	
	第３０回利付国債（３０年）	60,000,000	77,388,000	
	第３１回利付国債（３０年）	30,000,000	38,317,800	
	第３２回利付国債（３０年）	50,000,000	64,891,000	
	第３３回利付国債（３０年）	50,000,000	62,505,500	
	第３４回利付国債（３０年）	70,000,000	90,206,200	
	第３６回利付国債（３０年）	80,000,000	100,820,800	
	第３７回利付国債（３０年）	40,000,000	49,767,200	
	第３８回利付国債（３０年）	20,000,000	24,565,600	
	第３９回利付国債（３０年）	70,000,000	87,479,000	
	第４２回利付国債（３０年）	70,000,000	84,864,500	
	第４４回利付国債（３０年）	20,000,000	24,283,800	
	第４５回利付国債（３０年）	30,000,000	35,180,700	
	第４６回利付国債（３０年）	90,000,000	105,581,700	
	第４７回利付国債（３０年）	20,000,000	23,902,000	
	第４９回利付国債（３０年）	40,000,000	46,102,000	

第５０回利付国債（３０年）	80,000,000	81,649,600	
第５３回利付国債（３０年）	40,000,000	38,864,800	
第５４回利付国債（３０年）	120,000,000	121,911,600	
第５８回利付国債（３０年）	140,000,000	141,527,400	
第６０回利付国債（３０年）	110,000,000	113,408,900	
第６１回利付国債（３０年）	120,000,000	117,736,800	
第６７回利付国債（３０年）	240,000,000	227,066,400	
第６９回利付国債（３０年）	50,000,000	48,599,500	
第７２回利付国債（３０年）	50,000,000	48,512,500	
第１１１回利付国債（２０年）	60,000,000	69,359,400	
第１１３回利付国債（２０年）	50,000,000	57,665,000	
第１１４回利付国債（２０年）	50,000,000	57,869,000	
第１１６回利付国債（２０年）	70,000,000	81,858,000	
第１１８回利付国債（２０年）	60,000,000	69,424,200	
第１２１回利付国債（２０年）	60,000,000	69,105,000	
第１２３回利付国債（２０年）	110,000,000	128,987,100	
第１２５回利付国債（２０年）	130,000,000	154,018,800	
第１２８回利付国債（２０年）	130,000,000	150,862,400	
第１３０回利付国債（２０年）	150,000,000	173,044,500	
第１３２回利付国債（２０年）	90,000,000	103,206,600	
第１３６回利付国債（２０年）	200,000,000	227,744,000	
第１３７回利付国債（２０年）	50,000,000	57,525,500	
第１４０回利付国債（２０年）	60,000,000	69,138,000	
第１４１回利付国債（２０年）	60,000,000	69,274,200	
第１４３回利付国債（２０年）	100,000,000	114,530,000	
第１４５回利付国債（２０年）	60,000,000	69,496,200	
第１４６回利付国債（２０年）	130,000,000	150,848,100	
第１４７回利付国債（２０年）	80,000,000	92,018,400	
第１４８回利付国債（２０年）	60,000,000	68,413,200	
第１４９回利付国債（２０年）	110,000,000	125,583,700	
第１５０回利付国債（２０年）	120,000,000	135,712,800	
第１５２回利付国債（２０年）	140,000,000	155,012,200	
第１５３回利付国債（２０年）	150,000,000	168,081,000	
第１５４回利付国債（２０年）	110,000,000	121,911,900	
第１５５回利付国債（２０年）	150,000,000	162,246,000	
第１５７回利付国債（２０年）	140,000,000	135,828,000	
第１５８回利付国債（２０年）	100,000,000	101,101,000	
第１５９回利付国債（２０年）	120,000,000	122,848,800	
第１６０回利付国債（２０年）	100,000,000	103,757,000	
第１６２回利付国債（２０年）	180,000,000	183,670,200	
第１６４回利付国債（２０年）	140,000,000	140,313,600	
第１６６回利付国債（２０年）	140,000,000	144,293,800	

	第１６７回利付国債（２０年）	80,000,000	79,751,200	
	第１６９回利付国債（２０年）	150,000,000	144,055,500	
	第１７２回利付国債（２０年）	120,000,000	116,554,800	
	第１７６回利付国債（２０年）	140,000,000	137,481,400	
国債証券 合計		7,420,000,000	8,013,942,300	
社債券	第２３回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	99,970,000	
	第３５回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	99,574,000	
	第９回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー期限前償還条項付	100,000,000	99,384,000	
	第３回香港上海銀行	100,000,000	99,464,000	
	第３回マラヤン・バンキング（２０１９）	100,000,000	100,013,000	
	第６回マラヤン・バンキング	200,000,000	199,678,000	
	第１回バークレイズ・ピーエルシー期限前償還条項付	100,000,000	101,270,000	
	第３回ソシエテ　ジェネラル円貨社債（２０１８）	100,000,000	100,409,000	
	ＵＢＳ　ＧＲＯＵＰ　ＦＵＮＤＩＮＧ（ＳＷＩＴＺＥＲＬＡＮＤ）	100,000,000	100,234,000	
	第１４回セブン&アイ・ホールディングス	100,000,000	99,977,000	
	第１６回Ｚホールディングス	100,000,000	100,558,000	
	第１９回Ｚホールディングス	100,000,000	99,423,000	
	第１５回楽天グループ	100,000,000	99,749,000	
	第３４回ソニー	100,000,000	99,838,000	
	第４３回ＩＨＩ	100,000,000	99,518,000	
	第４７回ＩＨＩ	100,000,000	99,804,000	
	第９回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	100,000,000	99,797,000	
	第１回明治安田生命２０１８基金	100,000,000	100,085,000	
	第１回日本生命２０１９基金	100,000,000	100,045,000	
	第１回明治安田生命２０１９基金	100,000,000	99,996,000	
	第１回楽天カード	100,000,000	99,900,000	
	第１回日本生命２０２１基金劣後特約付	100,000,000	99,948,000	
	第３５回丸井グループ	100,000,000	99,637,000	
	第２７回あおぞら銀行	100,000,000	100,036,000	
	第１３回三井住友トラスト・ホールディングス期限前償還条項付	100,000,000	99,912,000	
	第１８回みずほフィナンシャルグループ期限前償還条項付	100,000,000	99,926,000	
	第１６回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	100,000,000	100,092,000	
	第１４回ＳＢＩホールディングス	200,000,000	200,324,000	
	第１９回ＳＢＩホールディングス	100,000,000	99,973,000	
	第２３回ＳＢＩホールディングス	100,000,000	100,165,000	
	第７回イオンフィナンシャルサービス	100,000,000	99,955,000	
	第１１回イオンフィナンシャルサービス	100,000,000	99,838,000	
	第１６回イオンフィナンシャルサービス	200,000,000	199,330,000	
	第７５回アコム	100,000,000	100,146,000	

	第７９回アコム	100,000,000	100,060,000	
	第８１回アコム	100,000,000	99,293,000	
	第３６回大和証券グループ本社	100,000,000	99,589,000	
	第１回野村ホールディングス	100,000,000	100,004,000	
	第２回野村ホールディングス	100,000,000	99,856,000	
	第２回ソフトバンク	100,000,000	99,969,000	
	第８回ソフトバンク	100,000,000	99,902,000	
	第１１回ソフトバンク	100,000,000	99,590,000	
	第５００回関西電力	100,000,000	100,977,000	
	第１２回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,315,000	
	第２７回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,910,000	
	第３４回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101,557,000	
	第３８回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101,019,000	
	第１回東京電力リニューアブルパワー（グリーン）	100,000,000	99,881,000	
社債券 合計		5,100,000,000	5,100,890,000	
合計		12,520,000,000	13,114,832,300	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

フランス国債７－１０年ラダーマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	［令和 4年 2月 7日現在］
資産の部	
流動資産	
預金	1,047,480,708
コール・ローン	1,133,970,189
国債証券	23,675,002,335
派生商品評価勘定	1,829,800
未収入金	1,162,806
未収利息	94,338,562
前払費用	8,297,679
流動資産合計	25,962,082,079
資産合計	25,962,082,079
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	243,444,966
未払金	1,864,977,177
未払解約金	28,863

	［令和 4年 2月 7日現在］
未払利息	506
流動負債合計	2,108,451,512
負債合計	2,108,451,512
純資産の部	
元本等	
元本	21,924,501,872
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,929,128,695
元本等合計	23,853,630,567
純資産合計	23,853,630,567
負債純資産合計	25,962,082,079

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礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第６０条および第６１条にしたがって処理しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 4年 2月 7日現在]
１． 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	18,675,694,876円
期中追加設定元本額	8,372,395,060円
期中一部解約元本額	5,123,588,064円
元本の内訳※	
国内債券セレクション（ラップ向け）	680,929,557円
フランス国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）（ラップ向け）	6,146,316円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	15,178,964円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	19,455,963円
ＭＵＫＡＭ　フランス国債７－１０年ラダーオープン（為替ヘッジあり）（適格機関投資家転売制限付）	7,119,732,790円
ＭＵＫＡＭ　フランス国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）２０１７－０６（適格機関投資家限定）	556,341,610円

	[令和 4年 2月 7日現在]
ＭＵＫＡＭ　フランス国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）２０１８－０６（適格機関投資家限定）	1,939,056,331円
ＭＵＫＡＭ　フランス国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）２０１８－０７（適格機関投資家限定）	3,687,055,350円
ＭＵＫＡＭ　フランス国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）２０１８－１０（適格機関投資家限定）	464,932,756円
ＭＵＫＡＭ　フランス国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）２０１８－１１（適格機関投資家限定）	2,766,767,909円
ＭＵＫＡＭ　フランス国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）２０１９－０１（適格機関投資家限定）	3,773,808,898円
ＭＵＫＡＭ　フランス国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）２０１９－０５（適格機関投資家限定）	895,095,428円
合計	21,924,501,872円
２．　受益権の総数	21,924,501,872口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

１　金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第２条第４項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
２.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
３.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

２　金融商品の時価等に関する事項

区分	［令和 4年 2月 7日現在］
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	（1）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （2）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	［令和 4年 2月 7日現在］
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△1,102,112,296
合計	△1,102,112,296

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）
取引の時価等に関する事項

通貨関連
［令和 4年 2月 7日現在］

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	ユーロ	922,040,000	—	923,869,800	1,829,800
	売建				
	ユーロ	23,559,693,341	—	23,803,138,307	△243,444,966
合計		24,481,733,341	—	24,727,008,107	△241,615,166

（注）時価の算定方法

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

①為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

②当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	［令和 4年 2月 7日現在］
1口当たり純資産額	1.0880円
(1万口当たり純資産額)	(10,880円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨	種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
ユーロ	国債証券	0 0.A.T 291125	31,120,000.00	30,103,239.57	
		0 0.A.T 301125	31,420,000.00	30,035,006.40	
		0 0.A.T 311125	31,800,000.00	29,994,427.80	
		0.5 0.A.T 290525	29,688,000.00	29,927,700.91	
		1.5 0.A.T 310525	27,320,000.00	29,724,843.00	
		2.5 0.A.T 300525	25,300,000.00	29,598,039.90	
ユーロ合計			176,648,000.00	179,383,257.58 (23,675,002,335)	
合計				23,675,002,335 (23,675,002,335)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の(　)内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入債券時価比率	有価証券の合計金額に対する比率
ユーロ	国債証券 6銘柄	100.00%	100.00%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

ヘッジ付スペイン国債７－１０年ラダーマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	［令和 4年 2月 7日現在］
資産の部	
流動資産	
預金	77,509,163
コール・ローン	270,646,155
国債証券	10,473,849,211
未収入金	676,050
未収利息	54,134,836
流動資産合計	10,876,815,415
資産合計	10,876,815,415
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	107,373,912
未払解約金	21,648
未払利息	120
流動負債合計	107,395,680
負債合計	107,395,680
純資産の部	
元本等	
元本	10,363,028,082
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	406,391,653
元本等合計	10,769,419,735
純資産合計	10,769,419,735
負債純資産合計	10,876,815,415

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礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第６０条および第６１条にしたがって処理しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 4年 2月 7日現在]
１． 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	12,744,353,076円
期中追加設定元本額	353,123,517円
期中一部解約元本額	2,734,448,511円
元本の内訳※	
国内債券セレクション（ラップ向け）	709,556,243円
スペイン国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）（ラップ向け）	3,416,005円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	12,103,747円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	19,778,038円
ＭＵＫＡＭ　スペイン国債７－１０年ラダーオープン（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	2,775,947,187円
ＭＵＫＡＭ　スペイン国債７－１０年ラダーオープン（為替ヘッジあり）（適格機関投資家転売制限付）	1,854,362,363円
ＭＵＫＡＭ　スペイン国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）２０１９－０４（適格機関投資家限定）	3,952,101,761円
ＭＵＫＡＭ　スペイン国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）２０１９－０６（適格機関投資家限定）	285,727,804円
ＭＵＫＡＭ　スペイン国債７－１０年ラダーファンド（為替ヘッジあり）２０１９－０７（適格機関投資家限定）	750,034,934円
合計	10,363,028,082円
２． 受益権の総数	10,363,028,082口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

１　金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第２条第４項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

２　金融商品の時価等に関する事項

区分	［令和 4年 2月 7日現在］
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	［令和 4年 2月 7日現在］
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△622,217,775
合計	△622,217,775

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）
取引の時価等に関する事項

通貨関連

［令和 4年 2月 7日現在］

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	ユーロ	10,694,704,999	—	10,802,078,911	△107,373,912
合計		10,694,704,999	—	10,802,078,911	△107,373,912

（注）時価の算定方法

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

①為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

②当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	［令和 4年 2月 7日現在］
1口当たり純資産額	1.0392円
(1万口当たり純資産額)	(10,392円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨	種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
ユーロ	国債証券	0.1 SPAIN GOVT 310430	28,600,000.00	26,446,305.60	
		0.5 SPAIN GOVT 300430	27,180,000.00	26,490,443.40	
		1.45 SPAIN GOVT 290430	25,140,000.00	26,422,617.66	
ユーロ合計			80,920,000.00	79,359,366.66 (10,473,849,211)	
合計				10,473,849,211 (10,473,849,211)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の(　)内は、邦貨換算額であります。
(注2)合計金額欄の(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
ユーロ	国債証券　3銘柄	100.00%	100.00%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

日本超長期国債インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	［令和 4年 2月 7日現在］
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	205,059,037
国債証券	148,473,248,000
未収利息	455,213,595
前払費用	12,497,931

	［令和 4年 2月 7日現在］
流動資産合計	149,146,018,563
資産合計	149,146,018,563
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,377,719
未払利息	91
流動負債合計	2,377,810
負債合計	2,377,810
純資産の部	
元本等	
元本	150,962,911,249
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△1,819,270,496
元本等合計	149,143,640,753
純資産合計	149,143,640,753
負債純資産合計	149,146,018,563

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	［令和 4年 2月 7日現在］
1． 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	126,424,297,808円
期中追加設定元本額	31,384,480,375円
期中一部解約元本額	6,845,866,934円
元本の内訳※	
国内債券セレクション（ラップ向け）	5,668,009,280円
ＭＵＫＡＭ　日本超長期国債インデックスファンド（適格機関投資家限定）	140,288,772,157円
ＭＵＫＡＭ　スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	2,447,013,996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）	2,265,838,711円
アドバンスト・バランスⅢ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	136,884,949円
アドバンスト・バランスⅣ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	156,392,156円
合計	150,962,911,249円

	[令和 4年 2月 7日現在]
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。	1,819,270,496円
３． 受益権の総数	150,962,911,249口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

１　金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第２条第４項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
２.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
３.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

２　金融商品の時価等に関する事項

区分	［令和 4年 2月 7日現在］
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
２.時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	［令和 4年 2月 7日現在］
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△4,934,382,300
合計	△4,934,382,300

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）
取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	［令和 4年 2月 7日現在］
1口当たり純資産額	0.9879円
(1万口当たり純資産額)	(9,879円)

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第１回利付国債（４０年）	240,000,000	333,376,800	
	第２回利付国債（４０年）	960,000,000	1,291,046,400	
	第３回利付国債（４０年）	520,000,000	702,379,600	
	第４回利付国債（４０年）	840,000,000	1,141,929,600	
	第５回利付国債（４０年）	830,000,000	1,091,541,300	
	第６回利付国債（４０年）	930,000,000	1,204,322,100	
	第７回利付国債（４０年）	960,000,000	1,195,996,800	

第８回利付国債（４０年）	1,030,000,000	1,201,196,300	
第９回利付国債（４０年）	1,740,000,000	1,518,880,800	
第１０回利付国債（４０年）	1,530,000,000	1,561,227,300	
第１１回利付国債（４０年）	1,150,000,000	1,137,246,500	
第１２回利付国債（４０年）	1,260,000,000	1,124,474,400	
第１３回利付国債（４０年）	1,450,000,000	1,290,906,000	
第１４回利付国債（４０年）	1,480,000,000	1,404,520,000	
第１６回利付国債（３０年）	600,000,000	759,966,000	
第１７回利付国債（３０年）	530,000,000	666,194,100	
第２０回利付国債（３０年）	400,000,000	512,084,000	
第２２回利付国債（３０年）	800,000,000	1,029,872,000	
第２４回利付国債（３０年）	900,000,000	1,164,960,000	
第２５回利付国債（３０年）	770,000,000	976,606,400	
第２６回利付国債（３０年）	590,000,000	758,669,200	
第２７回利付国債（３０年）	930,000,000	1,214,328,900	
第２８回利付国債（３０年）	830,000,000	1,088,843,800	
第２９回利付国債（３０年）	890,000,000	1,158,272,700	
第３０回利付国債（３０年）	1,380,000,000	1,779,924,000	
第３１回利付国債（３０年）	1,210,000,000	1,545,484,600	
第３２回利付国債（３０年）	1,320,000,000	1,713,122,400	
第３３回利付国債（３０年）	1,180,000,000	1,475,129,800	
第３４回利付国債（３０年）	1,480,000,000	1,907,216,800	
第３５回利付国債（３０年）	1,520,000,000	1,910,184,000	
第３６回利付国債（３０年）	1,710,000,000	2,155,044,600	
第３７回利付国債（３０年）	1,600,000,000	1,990,688,000	
第３８回利付国債（３０年）	930,000,000	1,142,300,400	
第３９回利付国債（３０年）	1,050,000,000	1,312,185,000	
第４０回利付国債（３０年）	970,000,000	1,193,837,200	
第４１回利付国債（３０年）	1,070,000,000	1,296,230,100	
第４２回利付国債（３０年）	910,000,000	1,103,238,500	
第４３回利付国債（３０年）	1,060,000,000	1,286,087,400	
第４４回利付国債（３０年）	980,000,000	1,189,906,200	
第４５回利付国債（３０年）	1,040,000,000	1,219,597,600	
第４６回利付国債（３０年）	1,380,000,000	1,618,919,400	
第４７回利付国債（３０年）	1,030,000,000	1,230,953,000	
第４８回利付国債（３０年）	1,270,000,000	1,463,484,500	
第４９回利付国債（３０年）	1,280,000,000	1,475,264,000	
第５０回利付国債（３０年）	980,000,000	1,000,207,600	
第５１回利付国債（３０年）	1,220,000,000	1,108,052,800	
第５２回利付国債（３０年）	1,350,000,000	1,283,863,500	
第５３回利付国債（３０年）	1,070,000,000	1,039,633,400	
第５４回利付国債（３０年）	1,340,000,000	1,361,346,200	

第５５回利付国債（３０年）	890,000,000	903,323,300	
第５６回利付国債（３０年）	1,370,000,000	1,389,193,700	
第５７回利付国債（３０年）	770,000,000	780,025,400	
第５８回利付国債（３０年）	2,010,000,000	2,031,929,100	
第５９回利付国債（３０年）	920,000,000	906,880,800	
第６０回利付国債（３０年）	1,300,000,000	1,340,287,000	
第６１回利付国債（３０年）	770,000,000	755,477,800	
第６２回利付国債（３０年）	540,000,000	502,227,000	
第６３回利付国債（３０年）	910,000,000	821,830,100	
第６４回利付国債（３０年）	1,220,000,000	1,099,671,400	
第６５回利付国債（３０年）	820,000,000	737,696,600	
第６６回利付国債（３０年）	1,120,000,000	1,006,790,400	
第６７回利付国債（３０年）	1,320,000,000	1,248,865,200	
第６８回利付国債（３０年）	1,250,000,000	1,183,512,500	
第６９回利付国債（３０年）	1,110,000,000	1,078,908,900	
第７０回利付国債（３０年）	1,430,000,000	1,389,659,700	
第７１回利付国債（３０年）	1,280,000,000	1,243,648,000	
第７２回利付国債（３０年）	1,220,000,000	1,183,705,000	
第７３回利付国債（３０年）	350,000,000	339,517,500	
第１４３回利付国債（２０年）	2,150,000,000	2,462,395,000	
第１４４回利付国債（２０年）	140,000,000	158,830,000	
第１４５回利付国債（２０年）	1,990,000,000	2,304,957,300	
第１４６回利付国債（２０年）	2,500,000,000	2,900,925,000	
第１４７回利付国債（２０年）	2,190,000,000	2,519,003,700	
第１４８回利付国債（２０年）	2,420,000,000	2,759,332,400	
第１４９回利付国債（２０年）	2,720,000,000	3,105,342,400	
第１５０回利付国債（２０年）	1,990,000,000	2,250,570,600	
第１５１回利付国債（２０年）	1,780,000,000	1,969,854,800	
第１５２回利付国債（２０年）	2,370,000,000	2,624,135,100	
第１５３回利付国債（２０年）	3,150,000,000	3,529,701,000	
第１５４回利付国債（２０年）	1,090,000,000	1,208,036,100	
第１５５回利付国債（２０年）	2,740,000,000	2,963,693,600	
第１５６回利付国債（２０年）	1,230,000,000	1,229,175,900	
第１５７回利付国債（２０年）	2,430,000,000	2,357,586,000	
第１５８回利付国債（２０年）	1,300,000,000	1,314,313,000	
第１５９回利付国債（２０年）	1,390,000,000	1,422,998,600	
第１６０回利付国債（２０年）	1,860,000,000	1,929,880,200	
第１６１回利付国債（２０年）	1,580,000,000	1,614,049,000	
第１６２回利付国債（２０年）	1,330,000,000	1,357,118,700	
第１６３回利付国債（２０年）	1,370,000,000	1,396,290,300	
第１６４回利付国債（２０年）	2,200,000,000	2,204,928,000	
第１６５回利付国債（２０年）	1,190,000,000	1,190,892,500	

	第１６６回利付国債（２０年）	1,820,000,000	1,875,819,400	
	第１６７回利付国債（２０年）	1,350,000,000	1,345,801,500	
	第１６８回利付国債（２０年）	1,190,000,000	1,164,807,700	
	第１６９回利付国債（２０年）	1,680,000,000	1,613,421,600	
	第１７０回利付国債（２０年）	940,000,000	900,811,400	
	第１７１回利付国債（２０年）	1,460,000,000	1,396,081,200	
	第１７２回利付国債（２０年）	1,500,000,000	1,456,935,000	
	第１７３回利付国債（２０年）	1,620,000,000	1,570,298,400	
	第１７４回利付国債（２０年）	2,200,000,000	2,129,886,000	
	第１７５回利付国債（２０年）	1,510,000,000	1,485,658,800	
	第１７６回利付国債（２０年）	1,860,000,000	1,826,538,600	
	第１７７回利付国債（２０年）	1,460,000,000	1,405,688,000	
	第１７８回利付国債（２０年）	1,860,000,000	1,822,558,200	
	第１７９回利付国債（２０年）	440,000,000	431,041,600	
合計		137,090,000,000	148,473,248,000	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

２【ファンドの現況】

【国内債券セレクション（ラップ向け）】

【純資産額計算書】

令和 4年 2月28日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	38,181,431,463
Ⅱ　負債総額	52,165,058
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	38,129,266,405
Ⅳ　発行済口数	37,538,554,504口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0157
（10,000口当たり）	（10,157）

（参考）

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 2月28日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	666,474,250,640
Ⅱ　負債総額	12,602,544,646
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	653,871,705,994
Ⅳ　発行済口数	491,841,184,100口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3294
（10,000口当たり）	（13,294）

先進国高格付国債マザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 2月28日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	97,228,990,976
Ⅱ　負債総額	2,243,259,289
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	94,985,731,687
Ⅳ　発行済口数	86,831,686,989口

Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0939
（10,000口当たり）	（10,939）

ＭＵＡＭ　ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 2月28日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	147,083,121,781
Ⅱ　負債総額	2,001,078,559
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	145,082,043,222
Ⅳ　発行済口数	86,594,961,952口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6754
（10,000口当たり）	（16,754）

ショートデュレーション円インカムマザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 2月28日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	9,048,844,488
Ⅱ　負債総額	16,356,997
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	9,032,487,491
Ⅳ　発行済口数	9,416,295,437口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9592
（10,000口当たり）	（9,592）

三菱ＵＦＪ　国内債券アクティブマザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 2月28日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	12,814,250,646
Ⅱ　負債総額	14,666,570
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	12,799,584,076
Ⅳ　発行済口数	8,823,341,348口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4507

（10,000口当たり）	（14,507）

フランス国債７－１０年ラダーマザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 2月28日現在

（単位：円）

Ⅰ　資産総額	25,788,017,154
Ⅱ　負債総額	108,868
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	25,787,908,286
Ⅳ　発行済口数	23,758,971,985口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0854
（10,000口当たり）	（10,854）

ヘッジ付スペイン国債７－１０年ラダーマザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 2月28日現在

（単位：円）

Ⅰ　資産総額	10,717,036,284
Ⅱ　負債総額	2,424,929
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	10,714,611,355
Ⅳ　発行済口数	10,362,452,036口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0340
（10,000口当たり）	（10,340）

日本超長期国債インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 2月28日現在

（単位：円）

Ⅰ　資産総額	151,107,690,581
Ⅱ　負債総額	2,641,034,635
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	148,466,655,946
Ⅳ　発行済口数	150,982,187,846口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9833
（10,000口当たり）	（9,833）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換等

該当事項はありません。

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

（２）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

該当事項はありません。

（４）受益権の譲渡

①受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

②上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（５）受益権の譲渡の対抗要件

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額等

2022年2月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近５年間における資本金の額の増減はありません。

（２）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

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

・投資運用の意思決定機構

①投資環境見通しの策定

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

②運用戦略の決定

運用戦略委員会において、①で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

③運用計画の決定

②で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

④ポートフォリオの構築

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

⑤投資行動のモニタリング１

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

⑥投資行動のモニタリング２

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

⑦ファンドに関係する法人等の管理

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

⑧運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

２【事業の内容及び営業の概況】

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

託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。
2022年 2月28日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本　数 （本）	純資産総額 （百万円）
追加型株式投資信託	899	18,862,930
追加型公社債投資信託	16	1,349,427
単位型株式投資信託	89	407,755
単位型公社債投資信託	50	182,673
合　計	1,054	20,802,785

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

3【委託会社等の経理状況】

（１）財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

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

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

（２）監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第37期事業年度に係る中間会計期間（自 令和3年4月1日 至 令和3年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

(単位：千円)

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)

(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	※2	56,398,457	※2	56,803,388
有価証券		1,960,318		2,001
前払費用		575,904		598,135
未収入金		14,559		31,359
未収委託者報酬		10,296,453		13,216,357
未収収益	※2	638,994	※2	662,230
金銭の信託		100,000		2,300,000
その他		254,330		269,506
流動資産合計		70,239,017		73,882,978
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	584,048	※1	548,902
器具備品	※1	871,893	※1	1,435,369
土地		628,433		628,433
有形固定資産合計		2,084,375		2,612,705
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		3,369,611		3,569,171
ソフトウェア仮勘定		1,374,932		1,895,190
無形固定資産合計		4,760,365		5,480,184
投資その他の資産				
投資有価証券		16,704,756		18,616,670
関係会社株式		320,136		320,136
投資不動産	※1	819,255	※1	814,684
長期差入保証金		565,358		538,497
前払年金費用		375,031		258,835
繰延税金資産		1,912,824		916,962
その他		45,230		45,230
貸倒引当金		△23,600		△23,600
投資その他の資産合計		20,718,993		21,487,417
固定資産合計		27,563,734		29,580,307
資産合計		97,802,752		103,463,286

(単位：千円)

	第35期 (令和2年3月31日現在)		第36期 (令和3年3月31日現在)	
(負債の部)				
流動負債				
預り金		687,565		533,622
未払金				
未払収益分配金		131,478		158,856
未払償還金		395,400		133,877
未払手数料	※2	4,026,078	※2	5,200,810
その他未払金	※2	3,818,195	※2	4,412,521
未払費用	※2	4,402,578	※2	4,755,909
未払消費税等		629,469		752,617
未払法人税等		617,341		873,027

賞与引当金	933,517	933,381
役員賞与引当金	124,590	160,710
その他	701,285	691,143
流動負債合計	16,467,499	18,606,476
固定負債		
長期未払金	32,400	21,600
退職給付引当金	1,010,401	1,145,514
役員退職慰労引当金	130,784	117,938
時効後支払損引当金	238,811	245,426
固定負債合計	1,412,398	1,530,479
負債合計	17,879,897	20,136,956
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金	3,572,096	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712	44,732,712
利益剰余金		
利益準備金	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金	25,847,605	26,951,289
利益剰余金合計	33,188,194	34,291,879
株主資本合計	79,921,039	81,024,723

(単位：千円)

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

（２）【損益計算書】

(単位：千円)

	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）	第36期 （自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	67,967,489	67,963,712
投資顧問料	2,385,084	2,443,980
その他営業収益	16,085	21,613
営業収益合計	70,368,658	70,429,306
営業費用		

支払手数料	※2	27,106,451	※2	26,689,896
広告宣伝費		696,418		668,150
公告費		1,000		250
調査費				
調査費		1,857,271		2,077,942
委託調査費		11,579,175		12,035,954
事務委託費		847,769		798,528
営業雑経費				
通信費		153,731		296,490
印刷費		427,118		378,180
協会費		52,053		51,841
諸会費		15,990		16,613
事務機器関連費		1,953,926		1,977,769
その他営業雑経費		-		8,391
営業費用合計		44,690,907		45,000,009
一般管理費				
給料				
役員報酬		331,987		352,879
給料・手当		6,611,427		6,461,546
賞与引当金繰入		933,517		933,381
役員賞与引当金繰入		124,590		160,710
福利厚生費		1,276,950		1,272,568
交際費		11,871		2,721
旅費交通費		165,891		22,768
租税公課		360,165		402,939
不動産賃借料		647,402		666,331
退職給付費用		422,919		481,135
役員退職慰労引当金繰入		48,183		11,763
固定資産減価償却費		1,307,555		1,358,911
諸経費		427,212		413,538
一般管理費合計		12,669,674		12,541,193
営業利益		13,008,076		12,888,103

(単位：千円)

	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）		第36期 （自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金		90,965		170,807
受取利息	※2	4,169	※2	2,726
投資有価証券償還益		585,179		81,557
収益分配金等時効完成分		101,734		275,835
受取賃貸料	※2	65,808	※2	65,808
その他		19,987		12,504
営業外収益合計		867,845		609,239
営業外費用				
投資有価証券償還損		96,379		95,946
時効後支払損引当金繰入		-		16,395
事務過誤費		3,483		-
賃貸関連費用		20,339		13,472
その他		1,920		2,932

営業外費用合計		122,122		128,747
経常利益		13,753,799		13,368,595
特別利益				
投資有価証券売却益		174,842		2,007,655
特別利益合計		174,842		2,007,655
特別損失				
投資有価証券売却損		75,963		51,737
投資有価証券評価損		163,865		26,317
固定資産除却損	※1	8,832	※1	536
固定資産売却損		435		-
特別損失合計		249,096		78,591
税引前当期純利益		13,679,545		15,297,659
法人税、住民税及び事業税	※2	4,146,534	※2	4,755,427
法人税等調整額		79,824		△19,122
法人税等合計		4,226,359		4,736,304
当期純利益		9,453,186		10,561,354

（３）【株主資本等変動計算書】

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,069,594	33,410,184	80,143,028
当期変動額									
剰余金の配当							△9,675,175	△9,675,175	△9,675,175
当期純利益							9,453,186	9,453,186	9,453,186
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	―	―	―	―	―	―	△221,989	△221,989	△221,989
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	25,847,605	33,188,194	79,921,039

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,126,733	1,126,733	81,269,762
当期変動額			
剰余金の配当			△9,675,175
当期純利益			9,453,186
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△1,124,917	△1,124,917	△1,124,917
当期変動額合計	△1,124,917	△1,124,917	△1,346,907
当期末残高	1,815	1,815	79,922,854

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		

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

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

[注記事項]

（重要な会計方針）

1.有価証券の評価基準及び評価方法

(1)子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2)その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2.金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3.固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産及び投資不動産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	**5年～50年**
器具備品	**2年～20年**
投資不動産	**3年～47年**

(2)無形固定資産

定額法を採用しております。

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

4.外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5.引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権

等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

(2)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3)役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4)退職給付引当金

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

①退職給付見込額の期間帰属方法

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

②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5)役員退職慰労引当金

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

(6)時効後支払損引当金

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

6.その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(1)消費税等の会計処理

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

(2)連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

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

令和2年度税制改正において従来の連結納税制度が見直され、グループ通算制度に移行する税制改正法（「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号））が令和2年3月31日に公布されておりますが、繰延税金資産の額について、実務対応報告第39号「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」により企業会計基準適用指針第28号「税効果会計に係る会計基準の適用指針」第44項の定めを適用せず、改正前の税法の規定に基づいて算定しております。

（未適用の会計基準等）

・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）
・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）
・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）

(1)概要

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

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

(2)適用予定日
令和4年3月期の期首から適用します。
(3)当該会計基準等の適用による影響
「収益認識に関する会計基準」等の適用により、翌事業年度の期首の純資産に累積的影響額が反映され、繰越利益剰余金の期首残高が475,687千円増加すると見込まれます。

・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）

(1)概要
国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス（国際財務報告基準（IFRS）においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」）を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされております。
(2)適用予定日
令和4年3月期の期首から適用します。
(3)当該会計基準等の適用による影響
「時価の算定に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

（貸借対照表関係）
※1.有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

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

※2.関係会社に対する主な資産・負債
区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

（損益計算書関係）
※1.固定資産除却損の内訳

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

器具備品	8,832千円	536千円
計	8,832千円	536千円

※2.関係会社に対する主な取引
区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）	第36期 （自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）
支払手数料	5,234,629千円	5,128,270千円
受取利息	2千円	143千円
受取賃貸料	65,808千円	65,808千円
法人税、住民税及び事業税	3,030,180千円	3,492,898千円

（株主資本等変動計算書関係）
第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）
1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2.配当に関する事項
(1)配当金支払額
令和元年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。
① 配当金の総額 9,675,175千円
② １株当たり配当額 45,728円
③ 基準日 平成31年3月31日
④ 効力発生日 令和元年6月27日

(2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
令和2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。
① 配当金の総額 9,457,670千円
② 配当の原資 利益剰余金
③ １株当たり配当額 44,700円
④ 基準日 令和2年3月31日
⑤ 効力発生日 令和2年6月29日

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）
1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2.配当に関する事項
(1)配当金支払額
令和2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。
① 配当金の総額 9,457,670千円
② １株当たり配当額 44,700円
③ 基準日 令和2年3月31日
④ 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。

①	配当金の総額	10,576,511千円
②	配当の原資	利益剰余金
③	１株当たり配当額	49,988円
④	基準日	令和3年3月31日
⑤	効力発生日	令和3年6月29日

（リース取引関係）

〈借主側〉

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

	第35期 （令和2年3月31日現在）	第36期 （令和3年3月31日現在）
1年内	675,956千円	709,808千円
1年超	―	709,808千円
合計	675,956千円	1,419,616千円

（金融商品関係）

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、金銭の信託（合同運用指定金銭信託）で運用し、金融機関からの資金調達は行っておりません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2.金融商品の時価等に関する事項

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

第35期(令和2年3月31日現在)

		貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1)	現金及び預金	56,398,457	56,398,457	―
(2)	有価証券	1,960,318	1,960,318	―
(3)	金銭の信託	100,000	100,000	―
(4)	未収委託者報酬	10,296,453	10,296,453	―
(5)	投資有価証券	16,673,396	16,673,396	―
	資産計	85,428,625	85,428,625	―
(1)	未払手数料	4,026,078	4,026,078	―
	負債計	4,026,078	4,026,078	―

第36期(令和3年3月31日現在)

		貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1)	現金及び預金	56,803,388	56,803,388	―
(2)	有価証券	2,001	2,001	―
(3)	金銭の信託	2,300,000	2,300,000	―
(4)	未収委託者報酬	13,216,357	13,216,357	―
(5)	投資有価証券	18,585,310	18,585,310	―

資産計	90,907,057	90,907,057	－
(1)　未払手数料	5,200,810	5,200,810	－
負債計	5,200,810	5,200,810	－

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資　産

(1)現金及び預金、(4)未収委託者報酬

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

(2)有価証券、(5)投資有価証券

これらはすべて投資信託であり、時価は基準価額によっております。

(3)金銭の信託

時価は取引金融機関から提示された価格によっております。

負　債

(1)未払手数料

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
非上場株式	31,360	31,360
子会社株式	160,600	160,600
関連会社株式	159,536	159,536

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 投資有価証券」には含めておりません。

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

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第35期(令和2年3月31日現在)　（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	56,398,457	－	－	－
金銭の信託	100,000	－	－	－
未収委託者報酬	10,296,453	－	－	－
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	1,960,318	5,652,257	4,813,929	27,375
合計	68,755,228	5,652,257	4,813,929	27,375

第36期(令和3年3月31日現在)　（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	56,803,388	－	－	－
金銭の信託	2,300,000	－	－	－
未収委託者報酬	13,216,357	－	－	－
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	2,001	8,412,286	3,123,026	11,398

合計	72,321,747	8,412,286	3,123,026	11,398

（有価証券関係）

1.子会社株式及び関連会社株式

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

2.その他有価証券

第35期(令和2年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株式	―	―	―
	債券	―	―	―
	その他	9,859,345	8,694,010	1,165,334
	小計	9,859,345	8,694,010	1,165,334
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株式	―	―	―
	債券	―	―	―
	その他	8,874,369	10,037,087	△1,162,718
	小計	8,874,369	10,037,087	△1,162,718
合計		18,733,714	18,731,098	2,616

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

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。

第36期(令和3年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株式	―	―	―
	債券	―	―	―
	その他	14,810,957	11,362,471	3,448,485
	小計	14,810,957	11,362,471	3,448,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株式	―	―	―
	債券	―	―	―
	その他	6,076,354	6,207,447	△131,093
	小計	6,076,354	6,207,447	△131,093
合計		20,887,311	17,569,919	3,317,392

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

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

3.売却したその他有価証券

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
株式	8,940	―	15,060
債券	―	―	―
その他	2,035,469	174,842	60,903
合計	2,044,409	174,842	75,963

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）

株式	―	―	―
債券	―	―	―
その他	5,747,529	2,007,655	51,737
合計	5,747,529	2,007,655	51,737

4.減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について163,865千円（その他有価証券のその他163,865千円）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について26,317千円（その他有価証券のその他26,317千円）減損処理を行っております。

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

（退職給付関係）

1.採用している退職給付制度の概要

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

2.確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）	第36期 （自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）
退職給付債務の期首残高	3,712,289 千円	3,718,736 千円
勤務費用	204,225	203,106
利息費用	17,557	19,110
数理計算上の差異の発生額	△52,430	△18,826
退職給付の支払額	△162,904	△192,890
過去勤務費用の発生額	―	―
退職給付債務の期末残高	3,718,736	3,729,235

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	2,969,807 千円	2,810,893 千円
年金資産	△2,460,824	△2,649,846
	508,982	161,046
非積立型制度の退職給付債務	748,929	918,342
未積立退職給付債務	1,257,911	1,079,388

未認識数理計算上の差異	△203,136	161,333
未認識過去勤務費用	△419,405	△354,043
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635,370	886,678

退職給付引当金	1,010,401	1,145,514
前払年金費用	△375,031	△258,835
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635,370	886,678

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

（注）「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額、再就職支援金及び退職金です。

(5)年金資産に関する事項

①年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

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

②長期期待運用収益率の設定方法

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

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
割引率	0.095～0.52%	0.051～0.59%
長期期待運用収益率	1.5～1.8%	1.5～1.8%

3.確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度153,070千円、当事業年度151,880千円であります。

（税効果会計関係）

1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
繰延税金資産		

減損損失	427,046千円	418,394千円
投資有価証券評価損	226,322	188,859
未払事業税	117,461	180,263
賞与引当金	285,842	285,801
役員賞与引当金	19,703	25,472
役員退職慰労引当金	40,046	36,112
退職給付引当金	309,384	350,756
減価償却超過額	96,767	68,024
委託者報酬	213,044	209,938
長期差入保証金	40,180	48,639
時効後支払損引当金	73,124	75,149
連結納税適用による時価評価	57,656	38,873
その他	123,248	87,023
繰延税金資産　小計	2,029,829	2,013,308
評価性引当額	―	―
繰延税金資産　合計	2,029,829	2,013,308
繰延税金負債		
前払年金費用	△114,834	△79,225
連結納税適用による時価評価	△1,260	△1,203
その他有価証券評価差額金	△801	△1,015,785
その他	△109	△101
繰延税金負債　合計	△117,005	△1,096,346
繰延税金資産の純額	1,912,824	916,962

2.法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
第35期（令和2年3月31日現在）及び第36期（令和3年3月31日現在）
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

（セグメント情報等）
[セグメント情報]
第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）及び第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）
当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]
第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）及び第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）
1.製品及びサービスごとの情報
単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2.地域ごとの情報
（1）営業収益
投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。
（2）有形固定資産
本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3.主要な顧客ごとの情報
投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]
当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]
当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]
当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)
1.関連当事者との取引
(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等
第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注4）	科目	期末残高（注4）
親会社	㈱三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,141,513百万円	銀行持株会社業	被所有間接100.0%	連結納税	連結納税に伴う支払（注1）	3,030,180千円	その他未払金	3,029,426千円
親会社	三菱UFJ信託銀行㈱	東京都千代田区	324,279百万円	信託業、銀行業	被所有直接100.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注2）	5,234,629千円	未払手数料	712,210千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料（注3）	583,270千円	未払費用	302,681千円

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注4）	科目	期末残高（注4）
親会社	㈱三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,141,513百万円	銀行持株会社業	被所有間接100.0%	連結納税	連結納税に伴う支払（注1）	3,492,898千円	その他未払金	3,425,136千円
親会社	三菱UFJ信託銀行㈱	東京都千代田区	324,279百万円	信託業、銀行業	被所有直接100.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注2）	5,128,270千円	未払手数料	772,495千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料（注3）	523,327千円	未払費用	290,120千円

取引条件及び取引条件の決定方針等
（注）１．連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。
２．投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。
３．投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。
４．上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等
第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注3）	科目	期末残高（注3）
同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 取引銀行	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注1） コーラブル預金の払戻（注2） コーラブル預金の預入（注2） コーラブル預金に係る受取利息（注2）	4,073,855千円 20,000,000千円 20,000,000千円 4,126千円	未払手数料 現金及び預金 未収収益	697,109千円 20,000,000千円 997千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注1）	5,714,501千円	未払手数料	944,351千円

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注3）	科目	期末残高（注3）
同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注1）	3,729,785千円	未払手数料	764,501千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注1）	5,655,482千円	未払手数料	1,193,245千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注)１．投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

２．預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は1年であります。

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

おります。

2.親会社に関する注記

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

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社（非上場）

（１株当たり情報）

	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）	第36期 （自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）
１株当たり純資産額	377,741.17円	393,827.09円
１株当たり当期純利益金額	44,678.80円	49,916.36円

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

2．１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）	第36期 （自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）
当期純利益金額　（千円）	9,453,186	10,561,354
普通株主に帰属しない金額　（千円）	－	－
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	9,453,186	10,561,354
普通株式の期中平均株式数　（株）	211,581	211,581

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

		第37期中間会計期間 (令和3年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金及び預金		48,742,270
有価証券		1,291,000
前払費用		682,143
未収入金		166,605
未収委託者報酬		15,228,560
未収収益		694,402
金銭の信託		5,301,000
その他		226,759
流動資産合計		72,332,741
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1	527,772
器具備品	※1	1,371,778
土地		628,433
有形固定資産合計		2,527,984
無形固定資産		
電話加入権		15,822
ソフトウェア		4,217,271
ソフトウェア仮勘定		1,478,970
無形固定資産合計		5,712,064
投資その他の資産		

投資有価証券		14,943,458
関係会社株式		320,136
投資不動産	※1	813,041
長期差入保証金		531,230
前払年金費用		224,272
繰延税金資産		733,199
その他		45,230
貸倒引当金		△23,600
投資その他の資産合計		17,586,969
固定資産合計		25,827,017
資産合計		98,159,759

(単位：千円)

	第37期中間会計期間 (令和3年9月30日現在)	
(負債の部)		
流動負債		
預り金		663,405
未払金		
未払収益分配金		187,200
未払償還金		7,418
未払手数料		6,029,978
その他未払金		2,623,176
未払費用		5,348,002
未払消費税等	※2	757,223
未払法人税等		702,806
賞与引当金		924,214
役員賞与引当金		65,985
その他		5,517
流動負債合計		17,314,927
固定負債		
長期未払金		10,800
退職給付引当金		1,204,214
役員退職慰労引当金		117,938
時効後支払損引当金		256,262
固定負債合計		1,589,215
負債合計		18,904,143
(純資産の部)		
株主資本		
資本金		2,000,131
資本剰余金		
資本準備金		3,572,096
その他資本剰余金		41,160,616
資本剰余金合計		44,732,712
利益剰余金		
利益準備金		342,589
その他利益剰余金		
別途積立金		6,998,000
繰越利益剰余金		23,330,110
利益剰余金合計		30,670,700
株主資本合計		77,403,544

(単位：千円)

	第37期中間会計期間 (令和3年9月30日現在)
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,852,071
評価・換算差額等合計	1,852,071
純資産合計	79,255,616
負債純資産合計	98,159,759

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第37期中間会計期間 （自 令和3年4月1日 至 令和3年9月30日）
営業収益		
委託者報酬		39,061,243
投資顧問料		1,319,230
その他営業収益		7,249
営業収益合計		40,387,723
営業費用		
支払手数料		15,372,436
広告宣伝費		277,284
公告費		250
調査費		
調査費		1,187,915
委託調査費		7,042,637
事務委託費		653,911
営業雑経費		
通信費		75,781
印刷費		194,857
協会費		25,068
諸会費		9,036
事務機器関連費		1,066,190
その他営業雑経費		649
営業費用合計		25,906,022
一般管理費		
給料		
役員報酬		202,454
給料・手当		2,828,313
賞与引当金繰入		924,214
役員賞与引当金繰入		65,985
福利厚生費		637,293
交際費		2,635
旅費交通費		12,678
租税公課		232,446
不動産賃借料		364,289
退職給付費用		195,737
固定資産減価償却費	※1	969,675
諸経費		193,083
一般管理費合計		6,628,807
営業利益		7,852,893

(単位：千円)

	第37期中間会計期間 （自 令和3年4月1日 至 令和3年9月30日）

営業外収益		
受取配当金		203,195
受取利息		2,567
投資有価証券償還益		753,216
収益分配金等時効完成分		136,491
受取賃貸料		32,904
その他		4,621
営業外収益合計		1,132,996
営業外費用		
投資有価証券償還損		62
時効後支払損引当金繰入		21,921
事務過誤費		66,316
賃貸関連費用	※1	7,921
その他		7,123
営業外費用合計		103,345
経常利益		8,882,544
特別利益		
投資有価証券売却益		522,323
特別利益合計		522,323
特別損失		
投資有価証券売却損		8,073
投資有価証券評価損		36,558
固定資産除却損		7,408
特別損失合計		52,039
税引前中間純利益		9,352,828
法人税、住民税及び事業税		2,700,962
法人税等調整額		172,220
法人税等合計		2,873,183
中間純利益		6,479,644

(3)中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間（自 令和3年4月1日 至 令和3年9月30日）

(単位：千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,951,289	34,291,879	81,024,723
会計方針の変更による累積的影響額							475,687	475,687	475,687
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	27,426,976	34,767,566	81,500,410
当中間期変動額									
剰余金の配当							△10,576,511	△10,576,511	△10,576,511
中間純利益							6,479,644	6,479,644	6,479,644
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計	―	―	―	―	―	―	△3,621,178	△3,621,178	△3,621,178
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	23,330,110	30,670,700	77,403,544

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	

当期首残高	2,301,606	2,301,606	83,326,329
会計方針の変更による累積的影響額			475,687
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,301,606	2,301,606	83,802,017
当中間期変動額			
剰余金の配当			△10,576,511
中間純利益			6,479,644
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△449,534	△449,534	△449,534
当中間期変動額合計	△449,534	△449,534	△4,070,713
当中間期末残高	1,852,071	1,852,071	79,255,616

[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

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

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．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4) 退職給付引当金

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

① 退職給付見込額の期間帰属方法

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

② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5) 役員退職慰労引当金

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

(6) 時効後支払損引当金

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

5. 収益および費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主要な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1) 委託者報酬

投資信託の信託約款に基づき信託財産の運用指図等を行っております。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2) 投資顧問料

顧客との投資一任及び投資助言契約に基づき運用及び助言を行っております。当該報酬は契約期間にわたり収益として認識しております。

6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

7. その他中間財務諸表作成のための重要な事項

(1) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(2) 「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。

［会計方針の変更］

（収益認識に関する会計基準等の適用）

「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。以下「収益認識会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することといたしました。収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当中間会計期間の期首の繰越利益剰余金に加減し、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。

この結果、収益認識会計基準等の適用を行う前と比べて、当中間会計期間の中間貸借対照表は、流動負債のその他は588,191千円減少、繰延税金資産は180,104千円減少、繰越利益剰余金は408,087千円増加しております。

当中間会計期間の中間損益計算書は、委託者報酬、営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ97,433千円減少しております。

当中間会計期間の期首の純資産に累積的影響額が反映されたことにより、中間株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の期首残高は475,687千円増加しております。

1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

（時価の算定に関する会計基準等の適用）

「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。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「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）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。なお、時価算定会計基準等の適用による、中間財務諸表への影響はありません。また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うことといたしました。

[注記事項]

（中間貸借対照表関係）

※1　減価償却累計額

	第37期中間会計期間 （令和3年9月30日現在）
建物	661,109千円
器具備品	1,743,773千円
投資不動産	154,845千円

※2　消費税等の取扱い

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

（中間損益計算書関係）

※1　減価償却実施額

	第37期中間会計期間 （自　令和3年4月1日 至　令和3年9月30日）
有形固定資産	241,452千円
無形固定資産	728,222千円
投資不動産	3,012千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第37期中間会計期間（自　令和3年4月1日　至　令和3年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．配当に関する事項

令和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。

①	配当金の総額	10,576,511千円
②	配当の原資	利益剰余金
③	１株当たり配当額	49,988円
④	基準日	令和3年3月31日
⑤	効力発生日	令和3年6月29日

（リース取引関係）

第37期中間会計期間(令和3年9月30日現在)

〈借主側〉

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

1年内	709,808千円

1年超	354,904千円
合　　計	1,064,712千円

（金融商品関係）

第37期中間会計期間(令和3年9月30日現在)

1.金融商品の時価等に関する事項

令和3年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（（注２）参照）。

	中間貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1)　有価証券	1,291,000	1,291,000	－
(2)　金銭の信託	5,301,000	5,301,000	－
(3)　投資有価証券	14,912,098	14,912,098	－
資産計	21,504,098	21,504,098	－

（注1）「現金及び預金」、「未収委託者報酬」、「未払手数料」については短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注2）市場価格のない株式等

非上場株式（中間貸借対照表計上額31,360千円）は、市場価格がないため、「(3) 投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）は、市場価格がないため、記載しておりません。

（注3）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価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もあります。

2.金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

なお、中間財務諸表等規則附則（令和3年9月24日内閣府令第9号）に基づく経過措置を適用した投資信託（中間貸借対照表計上額 有価証券 1,291,000千円、投資有価証券14,912,098千円）は、次表には含めておりません。

時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	－	5,301,000	－	5,301,000
資産計	－	5,301,000	－	5,301,000

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しており、レベル2の時価に分類しております。

（有価証券関係）

第37期中間会計期間（令和3年9月30日現在）

1．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額　関係会社株式320,136千円）は、市場価格がないため、記載しておりません。

2．その他有価証券

	種類	中間貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株式	―	―	―
	債券	―	―	―
	その他	18,010,889	15,246,038	2,764,851
	小　計	18,010,889	15,246,038	2,764,851
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株式	―	―	―
	債券	―	―	―
	その他	3,493,209	3,588,600	△95,390
	小　計	3,493,209	3,588,600	△95,390
合　計		21,504,098	18,834,638	2,669,460

（注）「その他」には、中間貸借対照表の「金銭の信託」（中間貸借対照表計上額5,301,000千円、取得価額5,300,000千円）を含めております。
非上場株式（中間貸借対照表計上額31,360千円）については、市場価格がないため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3．減損処理を行った有価証券

当中間会計期間において、有価証券について36,558千円（その他有価証券のその他36,558千円）減損処理を行っております。
なお、減損処理にあたっては、中間期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

収益及び契約から生じるキャッシュ・フローの性質、金額、時期及び不確実性に影響を及ぼす主要な要因に基づく区分に当該収益を分解した情報については、重要性が乏しいため記載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37期中間会計期間（自　令和3年4月1日　至　令和3年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第37期中間会計期間（自　令和3年4月1日　至　令和3年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

（１株当たり情報）

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第37期中間会計期間 （令和3年9月30日現在）
1株当たり純資産額	374,587.58円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額（千円）	79,255,616
普通株式に係る中間期末の純資産額（千円）	79,255,616
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間期末の普通株式の数（株）	211,581

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第37期中間会計期間 （自 令和3年4月1日 至 令和3年9月30日）
1株当たり中間純利益金額	30,624.88円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額（千円）	6,479,644
普通株主に帰属しない金額（千円）	―
普通株式に係る中間純利益金額（千円）	6,479,644
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581

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

(注2)「会計方針の変更」に記載のとおり、「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）等を適用し、「収益認識に関する会計基準」第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当中間会計期間の1株当たり純資産額は2,248.25円増加し、1株当たり中間純利益金額は319.49円減少しております。

4【利害関係人との取引制限】

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

①自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

②運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

③通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

④委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

⑤上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5【その他】

①定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

②訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

①名称：三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社
（再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）
②資本金の額：324,279百万円（2021年９月末現在）
③事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

（２）販売会社

①名称	②資本金の額 （2021年９月末現在）	③事業の内容
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	324,279　百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。

２【関係業務の概要】

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

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

３【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2022年2月末現在）
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%（211,581株）を所有しています。
（注）関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が３％以上のものを記載しています。

第３【その他】

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

（２）投資信託説明書（交付目論見書）に、以下の趣旨の文言の全部または一部および有価証券届出書の主要内容を記載することがあります。

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

（３）投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。

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

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

（６）目論見書は「投資信託説明書」を別称として使用します。

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

独立監査人の監査報告書

令和3年6月28日

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

取　締　役　会　　御　中

有限責任監査法人ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	青　木　裕　晃	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊　藤　鉄　也	印

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

令和４年３月16日

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　鶴田　光夫

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　和田　渉

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている国内債券セレクション（ラップ向け）の令和３年２月６日から令和４年２月７日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、国内債券セレクション（ラップ向け）の令和４年２月７日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠
当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三菱ＵＦＪ国際投信株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

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

独立監査人の中間監査報告書

令和3年12月3日

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

取　締　役　会　　御　中

有限責任監査法人トーマツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員　業務執行社員	公認会計士	青　木　裕　晃	印
指定有限責任社員　業務執行社員	公認会計士	伊　藤　鉄　也	印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱ＵＦＪ国際投信株式会社の令和3年4月1日から令和4年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（令和3年4月1日から令和3年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱ＵＦＪ国際投信株式会社の令和3年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（令和3年4月1日から令和3年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- **不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。**
- **中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。**

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

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

利害関係

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

以　上

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