

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	令和4年5月31日
【計算期間】	第6期中(自 令和3年9月1日 至 令和4年2月28日)
【ファンド名】	コクサイ - MUGCトラスト - ウィントン・パフォーマンス連動ボンドプラスファンド16 - 03 (豪ドル建) (Kokusai - MUGC Trust - Bond Plus Fund Linked to the Performance of Winton 16-03 (AUD))
【発行者名】	ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A. (Mitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg) S.A.)
【代表者の役職氏名】	エグゼクティブ・ディレクター ファブリス・マス (Fabrice Mas)
【本店の所在の場所】	ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L - 1150、アーロン通 り 287 - 289番 (287-289, route d'Arlon, L-1150 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg)
【代理人の氏名又は名称】	弁護士 大西 信治
【代理人の住所又は所在地】	東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所
【事務連絡者氏名】	弁護士 大西 信治
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所
【電話番号】	03 (6212) 8316
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

１【ファンドの運用状況】

コクサイ－ＭＵＧＣトラスト－ウィントン・パフォーマンス連動ボンドプラスファンド16－03（豪ドル建）(Kokusai－MUGC Trust－Bond Plus Fund Linked to the Performance of Winton 16-03 (AUD))（以下「ファンド」といいます。）の運用状況は、以下のとおりです。

（１）【投資状況】（資産別および地域別の投資状況）

（2022年３月末日現在）

資産の種類	国名	時価合計 （オーストラリア・ドル）	投資比率 （％）
社債	ケイマン諸島	76,458,426.20	95.34
トータル・リターン・スワップ	英国	- 8,788,243.35	- 10.96
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		12,528,750.87	15.62
合計 （純資産価額）		80,198,933.72 （約7,378百万円）	100.00

（注１）投資比率とは、ファンドの純資産価額に対する当該資産の時価の比率です。以下同じです。

（注２）オーストラリア・ドル（以下「豪ドル」といいます。）の円貨換算は、便宜上、2022年３月31日現在の株式会社三菱ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（１豪ドル＝92.00円）によります。

（注３）ファンドは、ケイマン諸島の法律に基づいて設立されていますが、ファンドの受益証券（以下「受益証券」といいます。）は、豪ドル建てのため以下の金額表示は別段の記載がない限り豪ドル貨をもって行います。

（注４）本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入してあります。したがって、合計の数字が一致しない場合があります。また、円貨への換算は、本書の中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入してあります。したがって、本書中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もあります。

(2) 【運用実績】

【純資産の推移】

2022年３月末日前１年間における各月最終評価日の純資産の推移は、以下のとおりです。

	純資産価額		一口当たり純資産価格	
	豪ドル	百万円	豪ドル	円
2021年４月20日	106,393,691.65	9,788	0.9629	89
５月18日	100,414,967.06	9,238	0.9699	89
６月15日	98,140,854.22	9,029	0.9747	90
７月20日	94,093,433.67	8,657	0.9647	89
８月17日	92,850,235.57	8,542	0.9702	89
９月21日	91,239,268.03	8,394	0.9670	89
10月19日	89,365,140.41	8,222	0.9562	88
11月16日	84,551,544.99	7,779	0.9372	86
12月21日	81,013,075.52	7,453	0.9295	86
2022年１月18日	80,676,758.01	7,422	0.9302	86
２月15日	79,733,240.30	7,335	0.9237	85
３月15日	80,198,933.72	7,378	0.9324	86

【分配の推移】

該当事項はありません。

【収益率の推移】

計算期間	収益率（注）
2021年４月１日～2022年３月末日	- 3.21%

（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a = 2022年３月15日現在の一口当たり純資産価格

b = 2021年３月16日現在の一口当たり純資産価格

２【販売及び買戻しの実績】

2021年４月１日から2022年３月末日までの期間における受益証券の販売および買戻しの実績ならびに2022年３月末日現在の受益証券の発行済口数は、以下のとおりです。

販売口数	買戻口数	発行済口数
0 (0)	24,480,000 (24,480,000)	86,010,000 (86,010,000)

（注）（ ）の数は、本邦内における販売・買戻しおよび発行済口数です。

３【ファンドの経理状況】

- a．ファンドの日本文の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける法令および一般に認められる会計原則に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである（ただし、円換算部分を除く）。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b．ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c．ファンドの原文の中間財務書類は、豪ドルで表示されている。日本文の中間財務書類には、主要な金額について円換算額が併記されている。日本円による金額は、2022年3月31日現在における株式会社三菱ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1豪ドル＝92.00円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

（１）【資産及び負債の状況】

コクサイ - MUGCトラスト -
ウィントン・パフォーマンス連動ボンドプラスファンド16 - 03（豪ドル建）
貸借対照表
2022年３月１日現在
（豪ドルで表示）

	豪ドル	千円
資産		
投資有価証券（ロング）		
社債	77,386,637.40	7,119,571
株式スワップ	(9,808,730.32)	(902,403)
投資有価証券（ロング）合計	67,577,907.08	6,217,167
現金（ロング）		
現金および現金等価物	12,747,655.97	1,172,784
設立費用		
設立費用	4.90	0
未収利息		
未収利息	816.91	75
未収金		
未収金	224,925.00	20,693
資産合計	80,551,309.86	7,410,721
負債		
未払代行協会員報酬		
未払代行協会員報酬	(6,892.23)	(634)
未払監査報酬		
未払監査報酬	(36,547.34)	(3,362)
未払販売報酬		
未払販売報酬	(62,030.89)	(5,707)
未払投資顧問報酬		
未払投資顧問報酬	(92,963.24)	(8,553)
未払管理報酬		
未払管理報酬	(58,751.58)	(5,405)
未払投資運用報酬		
未払投資運用報酬	(41,800.37)	(3,846)
未払金		
未払金	1,618.59	149
未払報告書作成費用		
未払報告書作成費用	(13,876.68)	(1,277)
未払受託報酬		
未払受託報酬	(17,976.55)	(1,654)
負債合計	(329,220.29)	(30,288)
純資産総額	80,222,089.57	7,380,432
純資産価額	80,222,089.57	7,380,432
発行済口数	86,260,000 口	
１口当たり純資産価格	0.9300	86 円

コクサイ－ＭＵＧＣトラスト－

ウィントン・パフォーマンス連動ボンドプラスファンド16－03（豪ドル建）

損益計算書

2021年９月１日から2021年10月５日までの期間

（豪ドルで表示）

	豪ドル	千円
費用		
費用合計	0.00	0
収益		
実現損益	(15,158.62)	(1,395)
為替取引にかかる実現差損	(16.90)	(2)
市場にかかる実現利益	136,034.00	12,515
通貨にかかる実現利益	7.42	1
通貨にかかる実現損失	(19.72)	(2)
スワップにかかる実現損失	(151,163.42)	(13,907)
受取利息	(39,887.27)	(3,670)
債券利息	(78,637.04)	(7,235)
スワップ利息	38,749.77	3,565
未実現評価損益	(280,030.79)	(25,763)
未実現時価評価損益	(280,050.86)	(25,765)
未実現通貨運用評価損益	20.07	2
収益合計	(335,076.68)	(30,827)
費用		
費用－報酬	99,186.50	9,125
監査費用	3,406.44	313
報告書作成費用	306.60	28
投資運用報酬	18,541.04	1,706
受託報酬	2,781.17	256
立替費用	1,526.15	140
投資顧問報酬	9,270.52	853
管理報酬	16,686.81	1,535
代行協会員報酬	4,635.19	426
販売報酬	41,717.27	3,838
保管費用	315.31	29
費用合計	99,186.50	9,125
投資純利益	(434,263.18)	(39,952)

コクサイ - M U G C トラスト -
 ウィントン・パフォーマンス連動ボンドプラスファンド16 - 03（豪ドル建）
 損益計算書
 2021年10月６日から2022年３月１日までの期間
 （豪ドルで表示）

	豪ドル	千円
収益	154,870.10	14,248
経過利息の変動	53,032.18	4,879
株式スワップ	53,032.18	4,879
受取利息	69,846.30	6,426
現金および現金等価物	(15,236.68)	(1,402)
株式スワップ	85,082.98	7,828
受取利息	31,991.62	2,943
株式スワップ	31,991.62	2,943
費用	(354,480.41)	(32,612)
AIFMD費用	(1,170.75)	(108)
現金および現金等価物	(1,170.75)	(108)
代行協会員報酬	(16,831.53)	(1,549)
現金および現金等価物	(16,831.53)	(1,549)
監査報酬	(10,570.48)	(972)
現金および現金等価物	(10,570.48)	(972)
販売報酬	(151,483.82)	(13,937)
現金および現金等価物	(151,483.82)	(13,937)
投資顧問報酬	(67,326.15)	(6,194)
現金および現金等価物	(67,326.15)	(6,194)
管理報酬	(60,593.54)	(5,575)
現金および現金等価物	(60,593.54)	(5,575)
投資運用報酬	(33,663.07)	(3,097)
現金および現金等価物	(33,663.07)	(3,097)
財務書類作成費用	(1,235.14)	(114)
現金および現金等価物	(1,235.14)	(114)
保管費用	(1,448.75)	(133)
現金および現金等価物	(1,448.75)	(133)
受託報酬	(10,157.18)	(934)
現金および現金等価物	(10,157.18)	(934)
投資に係る実現および未実現損益	(3,149,811.77)	(289,783)
為替に係る未実現損益の変動	1,621.62	149
現金および現金等価物	1,621.62	149
価格に係る未実現損益の変動	(2,928,415.64)	(269,414)
社債	(3,957,686.17)	(364,107)
株式スワップ	1,029,270.53	94,693
長期価格に係る損益	(165,420.63)	(15,219)
社債	662,290.32	60,931
株式スワップ	(827,710.95)	(76,149)
短期価格に係る損益	(57,597.12)	(5,299)
株式スワップ	(57,597.12)	(5,299)
純損益	(3,349,422.08)	(308,147)

（２）【投資有価証券明細表等】

コクサイ - M U G C トラスト -
 ウィントン・パフォーマンス連動ボンドプラスファンド16 - 03（豪ドル建）
 投資ポジション評価明細表
 2022年３月１日現在

銘柄	投資ID	数量	現地価格	現地 取得原価	取得原価	未実現 利益/損失	経過利息	時価	投資 比率%
投資対象					83,459,277.37	-3,186,746.50	53,032.18	80,272,530.87	100.00%
現金（ロング）					12,747,661.14	-5.17	0.00	12,747,655.97	15.88%
現金および現金等価物					12,747,661.14	-5.17	0.00	12,747,655.97	15.88%
豪ドル					12,746,604.12	0.00	0.00	12,746,604.12	15.88%
豪ドル	AUD	12,746,604.12000	1.000000	12,746,604.12	12,746,604.12	0.00	0.00	12,746,604.12	15.88%
米ドル					1,057.02	-5.17	0.00	1,051.85	0.00%
米ドル	USD	763.59000	1.000000	763.59	1,057.02	-5.17	0.00	1,051.85	0.00%
投資有価証券（ロング）					70,711,616.23	-3,186,741.33	53,032.18	67,524,874.90	84.12%
社債					70,711,616.23	6,675,021.17	0.00	77,386,637.40	96.40%
豪ドル					70,711,616.23	6,675,021.17	0.00	77,386,637.40	96.40%
EARLS EIGHT LTD 0.570% 04/01/25 SR:753	XS138194302 3_KMTB39	86,010,000.00000	89.974000	70,711,616.23	70,711,616.23	6,675,021.17	0.00	77,386,637.40	96.40%
株式スワップ					0.00	-9,861,762.50	53,032.18	-9,861,762.50	-12.29%
豪ドル					0.00	-9,861,762.50	53,032.18	-9,861,762.50	-12.29%
Winton Ref Index TRS	Winton Ref Index TRS_2	86,260,000.00000	0.885674	0.00	0.00	-9,861,762.50	53,032.18	-9,861,762.50	-12.29%
未収金					225,746.81	0.00	0.00	225,746.81	100.00%
設立費用					4.90	0.00	0.00	4.90	0.00%
現金および現金等価物					4.90	0.00	0.00	4.90	0.00%
豪ドル					4.90	0.00	0.00	4.90	0.00%
豪ドル	AUD	4.90000	1.000000	4.90	4.90	0.00	0.00	4.90	0.00%
未収利息					816.91	0.00	0.00	816.91	0.36%
現金および現金等価物					816.91	0.00	0.00	816.91	0.36%
豪ドル					816.91	0.00	0.00	816.91	0.36%
豪ドル	AUD	816.91000	1.000000	816.91	816.91	0.00	0.00	816.91	0.36%
未収金					224,925.00	0.00	0.00	224,925.00	99.64%
現金および現金等価物					224,925.00	0.00	0.00	224,925.00	99.64%
豪ドル					224,925.00	0.00	0.00	224,925.00	99.64%
豪ドル	AUD	224,925.00000	1.000000	224,925.00	224,925.00	0.00	0.00	224,925.00	99.64%

銘柄	投資ID	数量	現地価格	現地 取得原価	取得原価	未実現 利益/損失	経過利息	時価	投資 比率%
未払金					-330,838.88	1,618.59	0.00	-329,220.29	100.00%
未払代行協会員報酬					-6,892.23	0.00	0.00	-6,892.23	2.09%
現金および現金等価物					-6,892.23	0.00	0.00	-6,892.23	2.09%
豪ドル					-6,892.23	0.00	0.00	-6,892.23	2.09%
豪ドル	AUD	-6,892.23000	1.000000	-6,892.23	-6,892.23	0.00	0.00	-6,892.23	2.09%
未払監査報酬					-36,547.34	0.00	0.00	-36,547.34	11.10%
現金および現金等価物					-36,547.34	0.00	0.00	-36,547.34	11.10%
ユーロ					-36,547.34	0.00	0.00	-36,547.34	11.10%
ユーロ	EUR	-23,080.09000	1.000000	-23,080.09	-36,547.34	0.00	0.00	-36,547.34	11.10%
未払販売報酬					-62,030.89	0.00	0.00	-62,030.89	18.84%
現金および現金等価物					-62,030.89	0.00	0.00	-62,030.89	18.84%
豪ドル					-62,030.89	0.00	0.00	-62,030.89	18.84%
豪ドル	AUD	-62,030.89000	1.000000	-62,030.89	-62,030.89	0.00	0.00	-62,030.89	18.84%
未払投資顧問報酬					-92,963.24	0.00	0.00	-92,963.24	28.24%
現金および現金等価物					-92,963.24	0.00	0.00	-92,963.24	28.24%
豪ドル					-92,963.24	0.00	0.00	-92,963.24	28.24%
豪ドル	AUD	-92,963.24000	1.000000	-92,963.24	-92,963.24	0.00	0.00	-92,963.24	28.24%
未払管理報酬					-58,751.58	0.00	0.00	-58,751.58	17.85%
現金および現金等価物					-58,751.58	0.00	0.00	-58,751.58	17.85%
豪ドル					-58,751.58	0.00	0.00	-58,751.58	17.85%
豪ドル	AUD	-58,751.58000	1.000000	-58,751.58	-58,751.58	0.00	0.00	-58,751.58	17.85%
未払投資運用報酬					-41,800.37	0.00	0.00	-41,800.37	12.70%
現金および現金等価物					-41,800.37	0.00	0.00	-41,800.37	12.70%
豪ドル					-41,800.37	0.00	0.00	-41,800.37	12.70%
豪ドル	AUD	-41,800.37000	1.000000	-41,800.37	-41,800.37	0.00	0.00	-41,800.37	12.70%
未払金					0.00	1,618.59	0.00	1,618.59	-0.49%
現金および現金等価物					0.00	1,618.59	0.00	1,618.59	-0.49%
ユーロ					0.00	1,590.24	0.00	1,590.24	-0.48%
ユーロ	EUR	0.00000	NA	0.00	0.00	1,590.24	0.00	1,590.24	-0.48%
米ドル					0.00	28.35	0.00	28.35	-0.01%
米ドル	USD	0.00000	NA	0.00	0.00	28.35	0.00	28.35	-0.01%
報告書作成費用					-13,876.68	0.00	0.00	-13,876.68	4.22%
現金および現金等価物					-13,876.68	0.00	0.00	-13,876.68	4.22%
ユーロ					-13,876.68	0.00	0.00	-13,876.68	4.22%
ユーロ	EUR	-8,738.67000	1.000000	-8,738.67	-13,876.68	0.00	0.00	-13,876.68	4.22%
未払受託報酬					-17,976.55	0.00	0.00	-17,976.55	5.46%
現金および現金等価物					-17,976.55	0.00	0.00	-17,976.55	5.46%
米ドル					-17,976.55	0.00	0.00	-17,976.55	5.46%
米ドル	USD	-13,029.49000	1.000000	-13,029.49	-17,976.55	0.00	0.00	-17,976.55	5.46%
報告額合計：					83,354,185.30	-3,185,127.91	53,032.18	80,169,057.39	100.00%

4【管理会社の概況】

（１）【資本金の額】（2022年３月末日現在）

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル（約229億円）

発行済株式総数 5,051,655株

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がありません。

（注）米ドルの円貨換算は、2022年３月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（１米ドル＝122.39円）によります。

（２）【事業の内容及び営業の状況】

管理会社は、投資信託の事務管理、国際的な保管業務、信託会計の事務管理およびこれらに関する一般的な銀行業務ならびに外国為替業務に従事します。

管理会社は、信託証書に基づき、期間の限定なく任命されていますが、受託会社は、以下の場合、かかる任命をただちに解除することができます。(a) 管理会社が清算される場合、(b) 管理会社の事業に関して財産保全管理人が任命された場合、(c) 受託会社が、管理会社の変更が受益者の利益にとって望ましいとの見解を有し、受益者に対してその旨を書面で表明した場合、(d) 決議が総会において投票を行った受益者の４分の３以上の多数により承認された場合、または(e) 発行済受益証券の価値の４分の３を保有する受益者が管理会社の解任を書面で受託会社に要求した場合。管理会社がファンドの管理者でなくなった場合、受託会社は、ファンドの管理者になる資格を有する他の者を任命しなければなりません。管理会社はまた、受託会社への通知により、管理会社の関係会社である他の管理者を後任者として、直ちに退任する権利を有します。ただし、管理会社が関係会社でない他の管理者を後任者として退任することを希望する場合、受託会社への60日前の通知が行われなければなりません。

信託証書の規定に基づき、管理会社は、故意の不適切な行為、詐欺または重過失の場合を除き、信託証書に基づく職務の遂行について、ファンド、受益者または受託会社に対していかなる責任も負いません。

信託証書に基づき、受託会社は、ファンドのために、かつファンドの資産からのみ、管理会社ならびに管理会社の関係会社、代理人および受任者ならびに管理会社およびこれらの者の役員、取締役、株主および支配者に対して、（ ）ファンドの運営もしくはファンドの受益証券の募集もしくは（ ）管理会社の行為に関係し、または信託証書に基づきファンドのために行われた事業もしくは業務に別途に関連して、管理会社が実際に負担したあらゆる損失、責任、損害、費用または経費（弁護士費用および会計士費用を含みますが、これらに限定されません。）、判決および和解において支払われる金額（ただし、受託会社が、ファンドを代表して、かかる和解を承認していることを条件とします。）を補償するものとし、上記の者を上記のあらゆる損失、責任、損害、費用または経費から免責するものとし、ただし、信託証書に基づく職務の遂行について、かかる行為が故意の不適切な行為、詐欺または重過失を構成する場合はこの限りではありません。

管理会社は、2022年２月末日現在、以下の投資信託の管理・運用を行っています。

国別（設立国）	種類別（基本的性格）	本数	純資産価額の合計
ケイマン諸島	アンブレラ・ファンドのサブ・ファンド	27	4,158,329,264.20米ドル

（３）【その他】

本書提出前６か月以内において、訴訟事件その他管理会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

5【管理会社の経理の概況】

- a．管理会社の日本文の中間財務書類は、管理会社が作成した原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b．管理会社の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c．管理会社の原文の中間財務書類は米ドルで表示されている。日本文の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2022年3月31日現在における株式会社三菱ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝122.39円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(1) 【資産及び負債の状況】

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表(財政状態計算書)

2021年6月30日現在

(単位:米ドル)

資産

米ドル

千円

		米ドル	千円
010	現金、中央銀行における現金残高およびその他の要求払預金	7,246,028,529.00	886,841,432
020	手元現金		
030	中央銀行における現金残高	5,362,012,390.00	656,256,696
040	その他の要求払預金	1,884,016,139.00	230,584,735
050	売買目的で保有される金融資産	107,280,955.27	13,130,116
060	デリバティブ	107,280,955.27	13,130,116
070	持分証券		
080	債務証券		
090	ローンおよび貸付金		
096	強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される 売買目的保有以外の金融資産	0.00	0
097	持分証券		
098	債務証券		
099	ローンおよび貸付金		
100	損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融資産	0.00	0
120	債務証券		
130	ローンおよび貸付金		
141	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産	2,939.77	360
142	持分証券	2,939.77	360
143	債務証券		
144	ローンおよび貸付金		
181	償却後原価における金融資産	1,466,622,700.00	179,499,952
182	債務証券		
183	ローンおよび貸付金	1,466,622,700.00	179,499,952
240	デリバティブ・ヘッジ会計		
250	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおける ヘッジ項目の公正価値変動		
260	子会社、合併会社および関連会社への投資		
270	有形資産	4,109,560.00	502,969
280	有形固定資産	4,109,560.00	502,969
290	投資不動産		
300	無形資産	3,715,285.88	454,714
310	営業権		
320	その他の無形資産	3,715,285.88	454,714
330	税金資産	634.46	78
340	現行税金資産	634.46	78
350	繰延税金資産		
360	その他の資産	28,126,532.00	3,442,406
370	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
380	資産合計	8,855,887,136.38	1,083,872,027

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表(財政状態計算書)

2021年6月30日現在

(単位:米ドル)

負債

		米ドル	千円
010	売買目的で保有される金融負債	43,403,070.62	5,312,102
020	デリバティブ	43,403,070.62	5,312,102
030	ショート・ポジション		
040	預金		
050	発行済み債務証券		
060	その他の金融負債		
070	損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして指定した金融負債	0.00	0
080	預金		
090	発行済み債務証券		
100	その他の金融負債		
110	償却後原価で測定される金融負債	8,290,907,401.92	1,014,724,157
120	預金	8,287,410,580.92	1,014,296,181
130	発行済み債務証券		
140	その他の金融負債	3,496,821.00	427,976
150	デリバティブ・ヘッジ会計		
160	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおけるヘッジ項目の公正価値変動		
170	引当金	0.00	0
180	年金およびその他の退職後給付金債務		
190	その他の長期従業員給付金		
200	再編		
210	係属中の法的問題および租税訟務		
220	コミットメントおよび保証		
230	その他の引当金		
240	税金負債	6,001,713.00	734,550
250	現行税金負債	5,196,887.00	636,047
260	繰延税金負債	804,826.00	98,503
270	要求払株式資本		
280	その他の負債	26,055,829.00	3,188,973
290	売却目的保有に分類される売却グループに含まれる負債		
300	負債合計	8,366,368,014.54	1,023,959,781

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表(財政状態計算書)

2021年6月30日現在

(単位:米ドル)

資本

		米ドル	千円
010	資本	187,117,965.90	22,901,368
020	払込資本	187,117,965.90	22,901,368
030	未払込請求資本		
040	株式発行差金		
050	資本を除く発行済みエクイティ商品	0.00	0
060	複合金融商品のエクイティ部分		
070	その他の発行済みエクイティ商品		
080	その他のエクイティ		
090	その他の累積包括利益	0.00	0
095	損益に再分類されることがない項目	0.00	0
100	有形資産		
110	無形資産		
120	確定給付型年金制度に係る数理計算上の利益または(-) 損失		
122	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
124	子会社、合併会社および関連会社への投資のその他の認識収益および費用の持分		
320	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動		
330	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値ヘッジに対するヘッジ非有効性		
340	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動〔ヘッジ項目〕		
350	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動〔ヘッジ手段〕		
360	負債の信用リスク変動に帰属する損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債の公正価値変動		
128	損益に再分類されることがある項目	0.00	0
130	外国事業純投資のヘッジ〔有効部分〕		
140	外貨換算		
150	ヘッジ・デリバティブ、キャッシュ・フロー・ヘッジ準備金〔有効部分〕		
155	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される債務証券の公正価値変動		
165	ヘッジ手段〔指定されていない要素〕		
170	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
180	子会社、合併会社および関連会社への投資のその他の認識収益および費用の持分		
190	利益剰余金	51,012.00	6,243
200	再評価準備金		
210	その他の準備金	287,051,461.95	35,132,228
220	持分法を用いて計上される子会社、合併会社および関連会社への投資の準備金または累積損失		
230	その他	287,051,461.95	35,132,228
240	(-) 自己株式		
250	親会社株主に帰属する損益	15,298,683.00	1,872,406

米ドル

千円

260	(-) 中間配当	0.00	
270	少数株主持分〔非支配持分〕	0.00	0
280	その他の累積包括利益		
290	その他の項目		
300	資本合計	489,519,122.85	59,912,245
310	資本および負債合計	8,855,887,137.00	1,083,872,027

(2)【損益の状況】

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

損益計算書

2021年6月30日に終了した期間

(単位:米ドル)

		米ドル	千円
010	利息収益	24,982,244.29	3,057,577
020	売買目的で保有される金融資産	14,527,723.86	1,778,048
025	強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される 売買目的保有以外の金融資産		
030	損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融資産		
041	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産		
051	償却後原価における金融資産	2,856,428.89	349,598
070	デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク		
080	その他の資産	274,086.66	33,545
085	負債に係る利息収益	7,324,004.88	896,385
090	(支払利息)	19,004,963.84	2,326,018
100	(売買目的で保有される金融負債)	84,365.71	10,326
110	(損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融負債)		
120	(償却後原価で測定される金融負債)	75,371.77	9,225
130	(デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク)		
140	(その他の負債)	2,730.93	334
145	(資産に係る支払利息)	18,842,495.43	2,306,133
150	(要求払株式資本に係る費用)		
160	受取配当	0.00	0
170	売買目的で保有される金融資産		
175	強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される 売買目的保有以外の金融資産		
191	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産		
192	持分法を用いて計上されるもの以外の子会社、合併会社および 関連会社への投資		
200	受取手数料	78,830,139.63	9,648,021
210	(支払手数料)	41,110,599.86	5,031,526
220	損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産および負 債の認識除外に係る利益または(-)損失、純額	0.00	0
231	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産		
241	償却後原価における金融資産		
260	償却後原価で測定される金融負債		
270	その他		
280	売買目的で保有される金融資産および負債に係る利益または (-)損失、純額	8,302,578.19	1,016,153
287	強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される売買目的保 有以外の金融資産に係る利益または(-)損失、純額		
290	損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして指定した 金融資産および負債に係る利益または(-)損失、純額		
300	ヘッジ会計からの利益または(-)損失、純額		
310	為替差額[利益または(-)損失]、純額		
320	子会社、合併会社および関連会社への投資に係る利益または (-)損失、純額		
330	非金融資産の認識除外に係る利益または(-)損失、純額		
340	その他の事業収益	3,261,533.33	399,179

米ドル

千円

350	（その他の事業費用）	1,727,802.18	211,466
355	事業収益合計、純額	53,533,129.56	6,551,920
360	（管理費用）	29,465,307.91	3,606,259
370	（従業員費用）	12,612,334.22	1,543,624
380	（その他の管理費用）	16,852,973.69	2,062,635
385	（破綻処理基金および預金保証制度に拠出する現金）	1,973,595.71	241,548
390	（減価償却）	1,394,486.93	170,671
400	（有形固定資産）	749,949.70	91,786
410	（投資不動産）		
420	（その他の無形資産）	644,537.23	78,885
425	修正利益または（－）損失、純額	0.00	0
426	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産		
427	償却後原価における金融資産		
430	（引当金または（－）引当金の戻入）	0.00	0
435	（破綻処理基金および預金保証制度に支払うコミットメント）		
440	（コミットメントおよび保証）		
450	（その他の引当金）		
460	（損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産に係る減損または（－）減損の戻入）	314,583.91	38,502
481	（その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産）		
491	（償却後原価における金融資産）	314,583.91	38,502
510	（子会社、合併会社および関連会社への投資の減損または（－）減損の戻入）		
520	（非金融資産に係る減損または（－）減損の戻入）	0.00	0
530	（有形固定資産）		
540	（投資不動産）		
550	（営業権）		
560	（その他の無形資産）		
570	（その他）		
580	損益認識されるマイナスの営業権		
590	持分法を用いて計上される子会社、合併会社および関連会社への投資の利益または（－）損失の持分		
600	非流動資産および非継続事業の条件を満たさない売却目的保有に分類される売却グループからの利益または（－）損失		
610	継続事業からの税引前利益または（－）損失	20,385,155.10	2,494,939
620	（継続事業からの損益に関する税金費用または（－）収入）	5,086,471.60	622,533
630	継続事業からの税引後利益または（－）損失	15,298,683.50	1,872,406
640	非継続事業からの税引後利益または（－）損失	0.00	0
650	非継続事業からの税引前利益または（－）損失		
660	（非継続事業に関する税金費用または（－）収入）		
670	当期利益または（－）損失	15,298,683.50	1,872,406
680	少数株主持分〔非支配持分〕に帰属する金額		
690	親会社株主に帰属する金額	15,298,683.50	1,872,406