

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年3月25日提出
【発行者名】	三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 横川 直
【本店の所在の場所】	東京都港区東新橋一丁目９番１号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【電話番号】	03-4223-3037
【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】	ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	１兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2023年9月25日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について半期報告書の提出に伴う関係情報の更新、投資対象マザーファンドの追加に伴う所要の変更および商号変更の記載等を行うため、本訂正届出書を提出します。

2【訂正の内容】

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

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

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

第一部【証券情報】

（４）【発行（売出）価格】

<訂正前>

取得申込受付日の翌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1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

<訂正後>

取得申込受付日の翌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アセットマネジメント株式会社

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1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

（８）【申込取扱場所】

<訂正前>

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）

<訂正後>

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アセットマネジメント株式会社

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）

（１２）【その他】

<更新後>

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】

<更新後>

当ファンドは、値上がり益の獲得および利子収益の確保をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、5,000億円です。

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

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
	海外	債券	MRF	
追加型		不動産投信		
	内外	その他資産 ()	ETF	特殊型 ()
		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 一般	年１回 年２回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり (部分ヘッジ)	日経２２５	ブル・ベア型
大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 不動産投信 その他資産 (投資信託証 券(資産複合 (株式、債 券))) 資産複合 ()	年４回 年６回 (隔月) 年１２回 (毎月) 日々 その他 ()	日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX その他 ()	条件付運用型 ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型 その他 ()

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<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「MRF及びMMF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「MRF及びMMF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（ＢＢＢ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

日本を含む先進国の株式および公社債等を実質的な主要投資対象とし、値上がり利益の獲得および利子収益の確保をめざします。

ファンドの特色

特色

1

日本を含む先進国の株式および公社債等に投資を行います。

※実際の運用は各マザーファンドへの投資を通じて行います。

<投資対象とするマザーファンドと運用目標>

各マザーファンド	主要投資対象	運用目標
TOPIXマザーファンド	日本の株式	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
外国株式インデックスマザーファンド	先進国の株式 (日本の株式を除く)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ	日本の国債	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。
国内債券インデックスマザーファンド	国内債券	NOMURA-BPI総合に連動する投資成果をめざして運用を行います。
日本短期債券マザーファンド	日本の公社債・ 金融商品	NOMURA-BPI短期インデックスをベンチマークとし、同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。
外国債券インデックスマザーファンド	先進国債券 (国内債券を除く)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド*	先進国債券 (国内債券を除く)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
新マネー・マーケット・マザーファンド	日本の 短期公社債等	主として安定した利子収益の確保をめざして運用を行います。

*為替ヘッジを行うマザーファンドです。

1 上記の他、短期金融資産に投資することがあります。

特色

2

三菱UFJ信託銀行からの投資助言・情報提供に基づき、投資環境等に応じて、各資産の組入比率を決定し運用を行います。

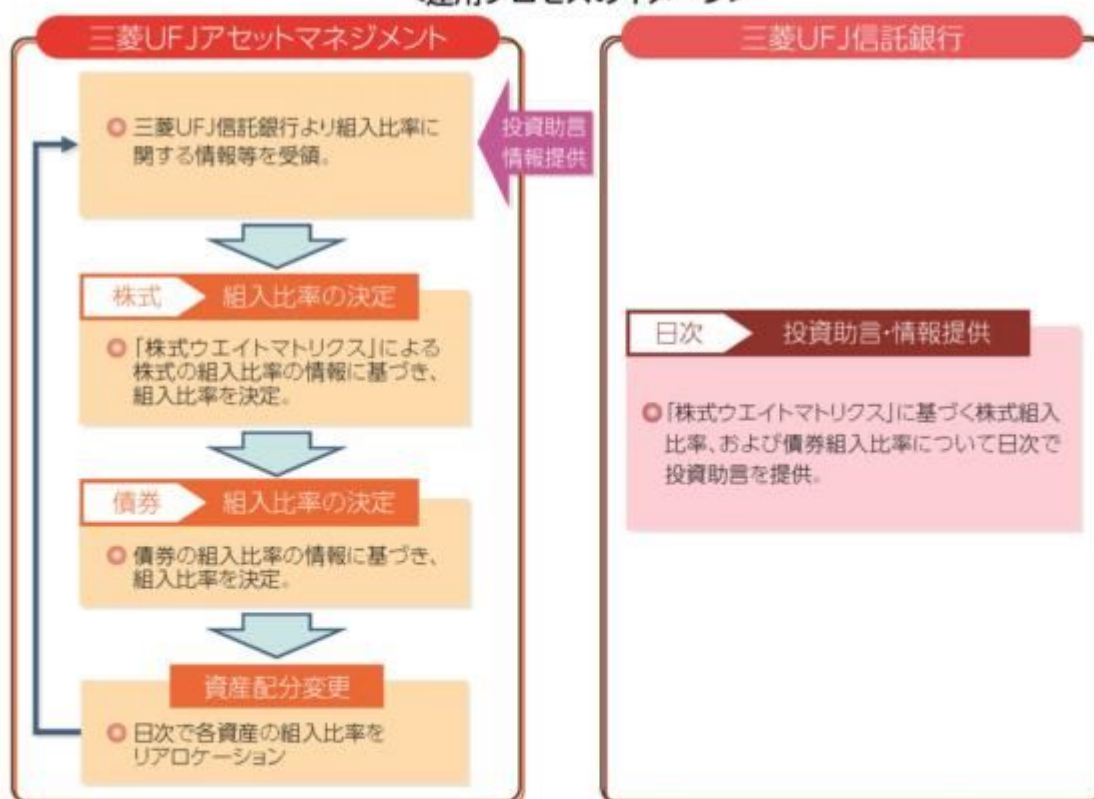
■運用方法・運用プロセス

<組入比率変更のイメージ>



❗ 上記はファンドの組入比率の変更をご理解いただくためにイメージとして示したもので、実際とは異なる場合があります。

<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を行わない場合があります。

❗ 投資助言者、投資助言・情報提供の内容、投資助言・情報提供の有無等については、変更する場合があります。

- 日本株式と先進国株式(日本株式を除く)の組入比率の決定にあたっては、投資環境と株式部分の収益寄与から比率を決定する「株式ウェイトマトリクス」を活用します。
 - ・「投資環境」は、株式市場や景気の方角性、信用リスクに対する市場の反応の大きさ、株式市場の値動きの大きさ等を測る複数の指標を用いて計算される相場局面判断インデックスをもとに判断します。
 - 「投資環境」を判断する各指標については、今後変更になる場合があります。
 - ・「株式部分の収益寄与」は、過去の株式の収益率に組入比率を勘案して算出します。

＜株式ウェイトマトリクスのイメージ＞



！ 上記の株式ウェイトマトリクスはイメージであり、実際のものとは異なります。なお、日本株式と先進国株式(日本株式を除く)の組入比率の決定に用いられる株式ウェイトマトリクスの設計は異なります。

- 公社債等の組入比率については、株式部分の組入比率を決定した後、原則として相場局面判断および投資環境等に基づき決定します。

☞ 「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でご覧いただけます。
<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>

特色3

実質組入外貨建資産について為替ヘッジを行う場合があります。

- 投資対象とするマザーファンドによっては、組入外貨建資産について為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図っている場合があります。
 - 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。
 - 為替ヘッジを行わない場合は、為替相場の変動による影響を受けます。
- ！ 為替ヘッジ(為替取引)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(為替取引によるコスト)がかかります。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(為替取引によるコスト)となる場合があります。

特色4

年1回の決算時(6月25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。

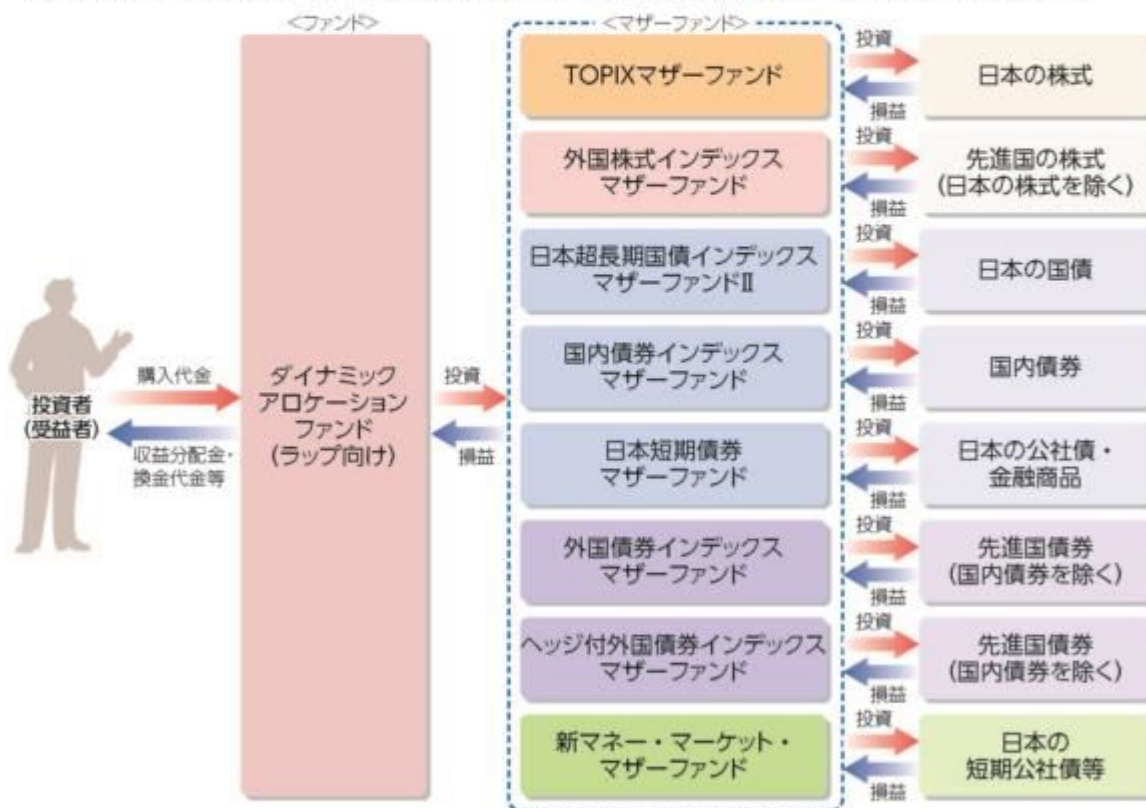
分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)

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

ファミリーファンド方式により、運用を行います。

ファミリーファンド方式とは、受益者から投資された資金をまとめた投資信託をベビーファンドとし、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資して、マザーファンドにおいて実質的な運用を行う仕組みです。



■主な投資制限

株式	株式への実質投資割合に制限を設けません。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
デリバティブ	デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。



指数について

- ・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。
- ・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。
MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。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。
- ・NOMURA-BPI国債 超長期(11-)とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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。
- ・NOMURA-BPI総合とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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。
- ・NOMURA-BPI短期インデックスとは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表しているわが国の残存期間1年から3年の債券で構成されている債券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。
- ・FTSE世界国債インデックス(除く日本)および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世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)は、FTSE世界国債インデックス(除く日本)・データに基づき委託会社が計算したものです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2)【ファンドの沿革】

< 訂正前 >

2021年11月30日	設定日、信託契約締結、運用開始
2022年10月6日	主要投資対象変更の重大な約款変更の適用 ファンドの投資対象に「国内債券インデックスマザーファンド」、「外国債券インデックスマザーファンド」、「ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド」を追加

< 訂正後 >

2021年11月30日	設定日、信託契約締結、運用開始
2022年10月6日	主要投資対象変更の重大な約款変更の適用 ファンドの投資対象に「国内債券インデックスマザーファンド」、「外国債券インデックスマザーファンド」、「ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド」を追加
2023年10月30日	主要投資対象変更の重大な約款変更の適用 ファンドの投資対象に「日本短期債券マザーファンド」を追加

(3) 【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

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）

信託財産の保管・管理等を行います。

投資 ↓ ↑ 損益

マザーファンド

投資 ↓ ↑ 損益

有価証券等

委託会社（委託者）
 三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。

< 訂正後 >

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）

信託財産の保管・管理等を行います。

投資 ↓ ↑ 損益

マザーファンド

投資 ↓ ↑ 損益

有価証券等

委託会社（委託者）
 三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。

< 訂正前 >

委託会社と関係法人との契約の概要

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

委託会社の概況（2023年6月末現在）

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

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

< 訂正後 >

委託会社と関係法人との契約の概要

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

委託会社の概況（2023年12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
 - 2023年10月 エム・ユー投資顧問株式会社の有価証券運用事業を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社へ統合し、商号を三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社に変更
- ・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】

<更新後>

ＴＯＰＩＸマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本超長期国債インデックスマザーファンド 受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、日本短期債券マザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券および新マネー・マーケット・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

ＴＯＰＩＸマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本超長期国債インデックスマザーファンド 受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、日本短期債券マザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券および新マネー・マーケット・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国を含む先進国の株式および公社債等に投資を行います。

株式の実質組入比率は、原則として相場の局面判断や株式の収益率等に基づいて決定します。

公社債等の実質組入比率については、株式部分の組入比率を決定した後、原則として相場局面判断および投資環境等に基づき決定します。

実質組入外貨建資産については、為替ヘッジを行う場合があります。

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。

（２）【投資対象】

<更新後>

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

１．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、信託約款に定める次のものに限りま。）

ａ．有価証券先物取引等

ｂ．スワップ取引

ｃ．金利先渡取引および為替先渡取引

ハ．約束手形

ニ．金銭債権

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社を受託会社とするＴＯＰＩＸマザーファンド、外国株式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、国内債券インデックスマザーファンド、日本短期債券マザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドおよび新マネー・マーケット・マザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

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

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

金融商品の指図範囲

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

- １．預金
- ２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）
- ３．コール・ローン
- ４．手形割引市場において売買される手形
- ５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
- ６．外国の者に対する権利で５．の権利の性質を有するもの
- ７．信託の受益権（金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるものをいい、１．から６．に該当するものを除きます。）
- ８．外国の者に対する権利で７．の権利の性質を有するもの
- ９．合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権（金融商品取引法第２条第２

項第３号で定めるものをいいます。）

10．外国法人の社員権で９．の権利の性質を有するもの

11．投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利（金融商品取引法第２条第２項第５号で定めるものをいいます。）

12．外国の法令に基づく権利であって、11．の権利に類するもの

その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

・外国為替予約取引

<マザーファンドの概要>

ＴＯＰＩＸマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）と連動する投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

東京証券取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資態度

主として対象インデックスに採用されている株式に投資を行い、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。

対象インデックスからカイ離するリスクと運用コストの極小化を目的として、定量的なリスク管理に基づいたポートフォリオ構築と適切な売買執行を行います。

株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数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。

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

（投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

同一銘柄の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。

外国株式インデックスマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式を主要投資対象とします。

投資態度

主として対象インデックスに採用されている株式に投資を行い、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。

- ・株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数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。

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。

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

（投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の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。

スワップ取引を行うことができます。

外国為替予約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、金利変動リスクおよび為替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。

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

日本超長期国債インデックスマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、NOMURA - B P I 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。

（運用方法）

投資対象

わが国の国債を主要投資対象とします。

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。

（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。

国内債券インデックスマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

主としてわが国の公社債に投資を行います。

公社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公社債の実質投資比率が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。

（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。

日本短期債券マザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、信託財産の安定的な成長をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

わが国の公社債・金融商品を主要投資対象とします。

投資態度

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

ポートフォリオのデュレーションはベンチマークの平均を中心に調整します。デュレーション調整は主としてファンダメンタルズ分析に基づく中期的な金利見通しに沿って行います。

銘柄選択は信用リスクと金利スプレッドを定量的・定性的に分析して行います。

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

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

（投資制限）

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

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

外国債券インデックスマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。

投資態度

主として対象インデックスに採用されている国債に投資を行い、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。

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。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引を行うことがあります。

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。

（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。

スワップ取引を行うことができます。

外国為替予約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、金利変動リスクおよび為替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。

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

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投資比率が100%を超える場合があります。

組入外貨建資産については、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、為替ヘッジ比率を引き下げる、あるいは為替ヘッジ比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

株式への投資割合は、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。

金利先渡し取引および為替先渡し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。

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、金利変動リスクおよび為替変動リスクを減じ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。

新マネー・マーケット・マザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、主として安定した利子収益の確保をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

わが国の公社債等を主要投資対象とします。

投資態度

主としてわが国の短期公社債等に投資を行います。

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。

（投資制限）

株式への投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

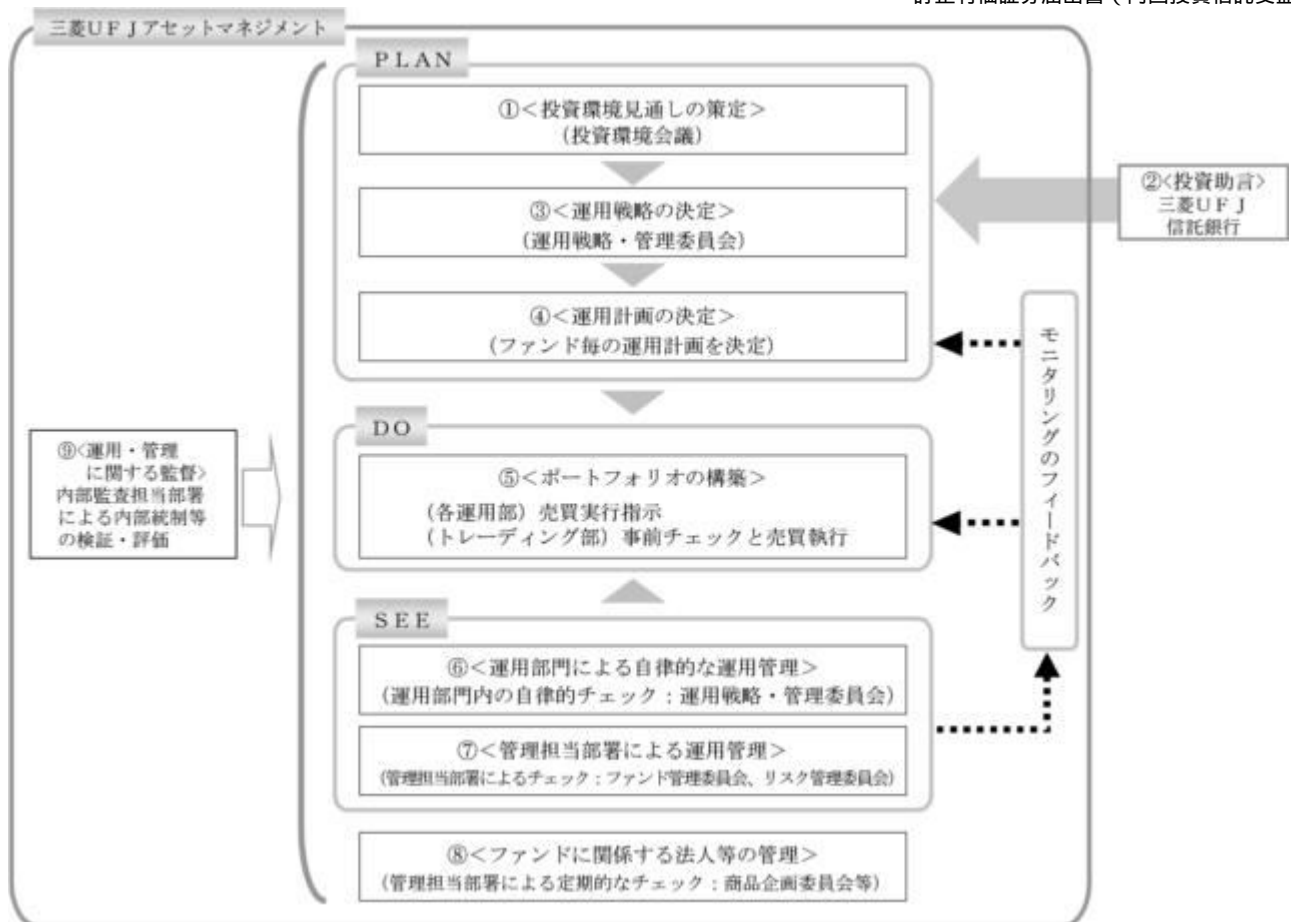
有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

金利先渡し取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

（３）【運用体制】

< 更新後 >



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。

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。

運用戦略の決定

運用戦略・管理委員会において、で策定された投資環境見通し、およびの投資助言に沿って運用戦略を決定します。

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

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

運用部門による自律的な運用管理

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、運用部門内の管理担当部署は逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また、運用戦略・管理委員会を通じて運用状況のモニタリングを行い、運用部門内での自律的牽制により運用改善を図ります。

管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、（a）運用に関するパフォーマンス測定・分析、意図した運用成果が得られていない場合にはその原因の分析のほか、（b）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、（a）についてはファンド管理委員会における審議を経て運用担当部・商品開発担当部にフィードバックされ、（b）についてはリスク管理委員会を通じて運用担当部にフィードバックされ、必要に応じて部署間連携の上で是正・改善の検討が行われます。

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、商品企画委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

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

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

3【投資リスク】

<更新後>

(1) 投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

（主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。）

価格変動 リスク	- 株式の価格は、株式市場全体の動向のほか、発行企業の業績や業績に対する市場の見通しなどの影響を受けて変動します。組入株式の価格の下落は、基準価額の下落要因となります。 - 債券の価格は、市場金利の変動の影響を受けて変動します。一般に市場金利が上がると、債券の価格は下落し、組入債券の価格の下落は基準価額の下落要因となります。市場金利の変動による債券価格の変動は、一般にその債券の残存期間が長いほど大きくなる傾向があります。
為替変動 リスク	投資対象とするマザーファンドによっては、組入外貨建資産について為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図っている場合があります。ただし、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がヘッジコストとなります。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。 また、為替ヘッジを行わない場合は、為替変動の影響を受けます。
信用リスク	有価証券等の発行企業の経営、財務状況が悪化したり、市場においてその懸念が高まった場合には、有価証券等の価格が下落（債券の場合は利回りが上昇）すること、配当金が減額あるいは支払いが停止、または利払いや償還金の支払いが滞ること、倒産等によりその価値がなくなること等があります。
流動性 リスク	有価証券等を売買しようとする際に、その有価証券等の取引量が十分でない場合や規制等により取引が制限されている場合には、売買が成立しなかったり、十分な数量の売買が出来なかったり、ファンドの売買自体によって市場価格が動き、結果として不利な価格での取引となる場合があります。

- ・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。
- ・有価証券の貸付等においては、取引先の倒産等による決済不履行リスクを伴い、ファンドが損失を被る可能性があります。
- ・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ある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、換金の申込みの受け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。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。
- ・ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・投資環境によっては、マイナス利回りの公社債や金融商品等での運用となることがあり、この場合、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、ファンド管理委員会およびリスク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。リスク管理委員会は、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。

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、法令等遵守のための管理態勢の状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

リスク管理担当部署

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

内部監査担当部署

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

* 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。



上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標準又は商標は、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に係る標準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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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の市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当該指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

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

１．収益分配金の課税

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

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

２．解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

個別元本について

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

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

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

収益分配金について

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

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

上記は2023年6月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

< 訂正後 >

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

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

１．収益分配金の課税

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

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

２．解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

個別元本について

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

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

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

収益分配金について

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

なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元

本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

上記は2023年12月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

【ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）】

（１）【投資状況】

2023年12月29日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	73,297,270,295	81.14
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	17,035,015,983	18.86
純資産総額		90,332,286,278	100.00

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

2023年12月29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	外国株式インデックスマザーファンド	3,212,468,918	5.7625	18,511,852,140	5.9177	19,010,427,316	21.04
日本	親投資信託受益証券	日本短期債券マザーファンド	16,031,537,190	1.1220	17,987,400,000	1.1229	18,001,813,110	19.93
日本	親投資信託受益証券	T O P I Xマザーファンド	3,846,127,133	2.7844	10,709,156,390	2.8722	11,046,846,351	12.23
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	4,021,839,748	2.4709	9,937,802,135	2.5343	10,192,548,473	11.28
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	7,308,971,051	1.1354	8,298,605,732	1.1422	8,348,306,734	9.24
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックスマザーファンド	4,826,156,130	0.9499	4,584,776,833	0.9321	4,498,460,128	4.98
日本	親投資信託受益証券	新マネー・マーケット・マザーファンド	2,222,650,544	0.9894	2,199,090,449	0.9893	2,198,868,183	2.43

（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

2023年12月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	81.14
合計	81.14

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および2023年12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（2022年 6月27日）	136,166,805,951	136,166,805,951	9,479	9,479
第2計算期間末日（2023年 6月26日）	106,790,857,557	106,790,857,557	9,759	9,759
2022年12月末日	130,805,396,903	—	9,217	—
2023年 1月末日	121,200,821,708	—	9,288	—
2月末日	118,501,585,920	—	9,363	—
3月末日	112,040,892,870	—	9,336	—
4月末日	108,809,752,643	—	9,412	—
5月末日	106,503,020,212	—	9,544	—
6月末日	106,863,298,414	—	9,807	—
7月末日	103,318,487,096	—	9,786	—
8月末日	101,446,668,178	—	9,780	—
9月末日	98,197,196,817	—	9,675	—
10月末日	93,589,076,809	—	9,514	—
11月末日	92,891,646,618	—	9,717	—
12月末日	90,332,286,278	—	9,770	—

【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

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	5.21
第2計算期間	2.95
第3中間計算期間	0.16

（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	182,050,778,220	38,393,864,258	143,656,913,962
第2計算期間	59,952,533,967	94,184,085,425	109,425,362,504
第3中間計算期間	191,130,193	16,794,805,397	92,821,687,300

（参考）

ＴＯＰＩＸマザーファンド

投資状況

2023年12月29日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	日本	1,175,357,990,550	99.87
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	1,476,177,007	0.13
純資産総額		1,176,834,167,557	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

2023年12月29日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	4,116,840,000	0.35

（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

2023年12月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	19,225,200	1,913.65	36,790,371,738	2,590.50	49,802,880,600	4.23
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2,476,700	11,750.57	29,102,659,475	13,410.00	33,212,547,000	2.82
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	21,000,000	884.21	18,568,617,005	1,211.50	25,441,500,000	2.16
日本	株式	キーエンス	電気機器	350,300	62,227.10	21,798,153,706	62,120.00	21,760,636,000	1.85
日本	株式	信越化学工業	化学	3,180,200	4,310.22	13,707,370,518	5,917.00	18,817,243,400	1.60
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	741,000	17,110.78	12,679,089,405	25,255.00	18,713,955,000	1.59
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	104,452,600	161.38	16,857,590,336	172.30	17,997,182,980	1.53
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,699,500	7,427.21	12,622,559,202	10,170.00	17,283,915,000	1.47
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2,451,700	5,422.65	13,294,718,742	6,880.00	16,867,696,000	1.43
日本	株式	三菱商事	卸売業	7,340,300	1,729.41	12,694,398,984	2,253.50	16,541,366,050	1.41
日本	株式	任天堂	その他製品	2,210,500	5,342.87	11,810,418,057	7,359.00	16,267,069,500	1.38
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	2,664,600	3,920.78	10,447,313,378	5,963.00	15,889,009,800	1.35
日本	株式	三井物産	卸売業	2,791,100	4,152.99	11,591,432,688	5,298.00	14,787,247,800	1.26
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	2,490,100	4,513.42	11,238,879,715	5,767.00	14,360,406,700	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	3,107,800	4,317.34	13,417,451,708	4,054.00	12,599,021,200	1.07
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	8,538,200	1,201.68	10,260,189,327	1,466.00	12,517,001,200	1.06

日本	株式	K D D I	情報・通信業	2,713,500	4,155.52	11,276,019,031	4,486.00	12,172,761,000	1.03
日本	株式	H O Y A	精密機器	689,300	14,390.99	9,919,715,161	17,625.00	12,148,912,500	1.03
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	3,408,500	2,675.68	9,120,075,785	3,529.00	12,028,596,500	1.02
日本	株式	第一三共	医薬品	3,059,100	4,618.75	14,129,242,682	3,872.00	11,844,835,200	1.01
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	4,654,500	1,942.11	9,039,578,360	2,412.50	11,228,981,250	0.95
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,732,200	5,215.20	9,033,785,420	6,293.00	10,900,734,600	0.93
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	1,904,700	4,536.83	8,641,308,396	5,251.00	10,001,579,700	0.85
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	5,650,500	1,568.88	8,864,987,867	1,759.50	9,942,054,750	0.84
日本	株式	ダイキン工業	機械	422,200	23,492.30	9,918,449,061	22,985.00	9,704,267,000	0.82
日本	株式	村田製作所	電気機器	3,185,500	2,627.83	8,370,960,759	2,993.00	9,534,201,500	0.81
日本	株式	S M C	機械	105,800	69,513.53	7,354,532,460	75,760.00	8,015,408,000	0.68
日本	株式	三菱電機	電気機器	3,935,900	1,624.78	6,394,984,008	1,999.00	7,867,864,100	0.67
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	2,094,900	2,849.43	5,969,272,309	3,645.00	7,635,910,500	0.65
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	1,276,700	5,856.31	7,476,751,853	5,595.00	7,143,136,500	0.61

（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

2023年12月29日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	水産・農林業	0.08
	鉱業	0.34
	建設業	2.11
	食料品	3.37
	繊維製品	0.40
	パルプ・紙	0.17
	化学	6.18
	医薬品	4.62
	石油・石炭製品	0.46
	ゴム製品	0.69
	ガラス・土石製品	0.67
	鉄鋼	0.96
	非鉄金属	0.68
	金属製品	0.52
	機械	5.33
	電気機器	17.53
	輸送用機器	8.18
	精密機器	2.36
	その他製品	2.38
	電気・ガス業	1.40
	陸運業	2.84
	海運業	0.84
	空運業	0.45
	倉庫・運輸関連業	0.14

情報・通信業	7.73
卸売業	6.99
小売業	4.29
銀行業	6.87
証券、商品先物取引業	0.81
保険業	2.38
その他金融業	1.15
不動産業	1.95
サービス業	4.98
小計	99.87
合計	99.87

（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

2023年12月29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（％）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ ２４年０３月限	買建	174	円	4,108,655,200	4,116,840,000	0.35

（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。

外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

2023年12月29日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	アメリカ	2,497,856,094,039	68.93
	イギリス	142,695,506,928	3.94
	カナダ	116,109,846,130	3.20
	フランス	107,204,079,227	2.96
	スイス	98,049,374,988	2.71
	ドイツ	83,165,186,951	2.29
	オーストラリア	70,486,505,990	1.95
	オランダ	59,526,328,339	1.64
	デンマーク	32,672,740,744	0.90
	スウェーデン	31,653,566,717	0.87
	スペイン	25,360,864,724	0.70
	香港	19,526,785,856	0.54
	イタリア	19,243,340,714	0.53
	フィンランド	10,700,680,366	0.30
	シンガポール	10,662,726,931	0.29
	ベルギー	7,485,841,048	0.21

	ノルウェー	6,525,878,569	0.18
	アイルランド	5,103,589,366	0.14
	イスラエル	3,707,299,444	0.10
	ニュージーランド	1,997,377,213	0.06
	ルクセンブルグ	1,868,952,895	0.05
	ポルトガル	1,854,411,097	0.05
	オーストリア	1,852,612,215	0.05
	バミューダ	580,517,546	0.02
	小計	3,355,890,108,037	92.60
投資証券	アメリカ	61,423,737,797	1.69
	オーストラリア	4,272,865,140	0.12
	シンガポール	1,505,938,053	0.04
	フランス	1,347,474,330	0.04
	イギリス	1,218,905,627	0.03
	香港	908,892,105	0.03
	ベルギー	319,520,137	0.01
	カナダ	305,389,600	0.01
	小計	71,302,722,789	1.97
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	196,784,656,923	5.43
純資産総額		3,623,977,487,749	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

2023年12月29日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	148,242,939,185	4.09
	買建	カナダ	6,639,502,934	0.18
	買建	ドイツ	23,415,680,016	0.65
	買建	オーストラリア	6,397,140,881	0.18
	買建	イギリス	8,242,801,376	0.23
	買建	スイス	5,449,784,860	0.15

（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

2023年12月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6,666,960	24,897.21	165,988,755,042	27,455.45	183,044,396,266	5.05

アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3,010,119	44,643.17	134,381,264,582	53,225.96	160,216,480,714	4.42
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	3,960,792	16,469.20	65,231,113,389	21,753.88	86,162,615,261	2.38
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,053,576	44,466.39	46,848,721,692	70,237.05	74,000,072,930	2.04
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	3,162,102	17,434.82	55,130,687,035	19,888.82	62,890,480,346	1.74
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	948,299	35,217.90	33,397,105,477	50,820.52	48,193,053,606	1.33
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1,219,019	26,664.36	32,504,364,735	35,908.51	43,773,167,410	1.21
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1,599,297	16,848.71	26,946,106,865	20,037.74	32,046,301,307	0.88
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	188,923	98,137.71	18,540,470,843	159,191.41	30,074,918,808	0.83
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1,238,730	19,574.39	24,247,386,443	24,153.64	29,919,849,626	0.83
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	395,096	69,670.45	27,526,517,433	74,446.56	29,413,540,835	0.81
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	344,420	64,058.72	22,063,106,960	82,381.95	28,373,993,113	0.78
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	金融サービス	557,283	46,496.05	25,911,458,938	50,714.15	28,262,135,382	0.78
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	685,153	32,956.82	22,580,467,166	36,932.53	25,304,435,097	0.70
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	1,709,675	15,078.25	25,778,920,953	14,209.94	24,294,392,334	0.67
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,027,864	22,828.31	23,464,399,950	22,207.74	22,826,537,906	0.63
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	358,808	54,677.85	19,618,852,208	60,464.96	21,695,313,377	0.60
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	427,629	41,429.82	17,716,596,699	49,266.06	21,067,599,735	0.58
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	1,004,805	21,842.56	21,947,515,695	20,668.88	20,768,199,897	0.57
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,395,214	12,337.12	17,212,928,575	14,718.05	20,534,837,784	0.57
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	172,178	93,831.22	16,155,671,952	107,768.60	18,555,383,388	0.51
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	1,139,094	19,039.06	21,687,285,879	16,283.94	18,548,949,286	0.51
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	188,957	72,558.63	13,710,462,886	94,047.47	17,770,928,356	0.49
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,083,709	16,384.68	17,756,226,517	15,426.84	16,718,215,211	0.46
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	753,713	20,739.68	15,631,768,480	21,948.19	16,542,638,014	0.46

アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	774,876	22,240.09	17,233,312,709	21,241.87	16,459,822,310	0.45
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	194,382	53,236.28	10,348,175,465	84,462.60	16,418,009,424	0.45
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	415,796	29,228.99	12,153,299,726	37,667.21	15,661,875,831	0.43
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	3,054,263	3,924.21	11,985,590,141	4,805.20	14,676,345,789	0.40
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	1,751,098	8,932.19	15,641,141,915	8,332.51	14,591,045,974	0.40

（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

2023年12月29日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	エネルギー	4.44
	素材	3.86
	資本財	6.57
	商業・専門サービス	1.50
	運輸	1.74
	自動車・自動車部品	1.97
	耐久消費財・アパレル	1.47
	消費者サービス	2.00
	メディア・娯楽	5.69
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.38
	生活必需品流通・小売り	1.62
	食品・飲料・タバコ	3.34
	家庭用品・パーソナル用品	1.54
	ヘルスケア機器・サービス	4.14
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.53
	銀行	5.21
	金融サービス	6.42
	保険	2.88
	ソフトウェア・サービス	9.59
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.41
	電気通信サービス	1.11
	公益事業	2.55
	半導体・半導体製造装置	6.30
	不動産管理・開発	0.34
小計		92.60
投資証券	—	1.97
合計		94.57

（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

2023年12月29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（％）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2403	買建	4,326	アメリカドル	1,021,907,138.08	144,937,089,394	1,045,215,675	148,242,939,185	4.09
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE602403	買建	244	カナダドル	60,678,101	6,507,119,551	61,912,560	6,639,502,934	0.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 2403	買建	3,279	ユーロ	150,357,168.97	23,624,118,389	149,030,550	23,415,680,016	0.65
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2403	買建	347	オーストラリアドル	64,537,054.25	6,256,222,038	65,990,725	6,397,140,881	0.18
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2403	買建	589	イギリスポンド	45,048,191.25	8,139,307,194	45,620,995	8,242,801,376	0.23
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX2403	買建	294	スイスフラン	32,678,623.9	5,497,851,684	32,392,920	5,449,784,860	0.15

（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。

国内債券インデックスマザーファンド

投資状況

2023年12月29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	158,679,027,930	82.74
地方債証券	日本	10,214,603,620	5.33
特殊債券	日本	9,165,379,807	4.78
社債券	日本	12,879,246,200	6.72
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	840,683,563	0.43
純資産総額		191,778,941,120	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

2023年12月29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	293,420,000	0.15

（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

2023年12月29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１５４回利付国債（５年）	2,940,000,000	99.87	2,936,425,000	99.98	2,939,441,400	0.100000	2027/9/20	1.53
日本	国債証券	第１４９回利付国債（５年）	2,700,000,000	99.75	2,693,470,000	99.89	2,697,057,000	0.005000	2026/9/20	1.41
日本	国債証券	第１４７回利付国債（５年）	2,680,000,000	99.76	2,673,728,700	99.94	2,678,499,200	0.005000	2026/3/20	1.40
日本	国債証券	第１６３回利付国債（５年）	2,600,000,000	100.67	2,617,460,000	100.86	2,622,412,000	0.400000	2028/9/20	1.37
日本	国債証券	第３７２回利付国債（１０年）	2,540,000,000	100.22	2,545,592,900	101.69	2,583,053,000	0.800000	2033/9/20	1.35
日本	国債証券	第１４８回利付国債（５年）	2,470,000,000	99.94	2,468,518,000	99.92	2,468,172,200	0.005000	2026/6/20	1.29
日本	国債証券	第１４６回利付国債（５年）	2,200,000,000	100.24	2,205,414,700	100.15	2,203,432,000	0.100000	2025/12/20	1.15
日本	国債証券	第１６１回利付国債（５年）	1,950,000,000	100.14	1,952,905,500	100.50	1,959,906,000	0.300000	2028/6/20	1.02
日本	国債証券	第１５６回利付国債（５年）	1,930,000,000	99.64	1,923,228,200	100.27	1,935,307,500	0.200000	2027/12/20	1.01
日本	国債証券	第３５７回利付国債（１０年）	1,890,000,000	98.92	1,869,752,500	99.03	1,871,704,800	0.100000	2029/12/20	0.98
日本	国債証券	第３６１回利付国債（１０年）	1,880,000,000	98.01	1,842,672,300	98.23	1,846,799,200	0.100000	2030/12/20	0.96
日本	国債証券	第１４４回利付国債（５年）	1,840,000,000	100.34	1,846,256,000	100.14	1,842,668,000	0.100000	2025/6/20	0.96
日本	国債証券	第１４３回利付国債（５年）	1,800,000,000	100.32	1,805,814,000	100.14	1,802,592,000	0.100000	2025/3/20	0.94
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	1,800,000,000	99.01	1,782,227,500	99.30	1,787,490,000	0.100000	2029/3/20	0.93
日本	国債証券	第１５３回利付国債（５年）	1,690,000,000	99.29	1,678,023,300	99.72	1,685,335,600	0.005000	2027/6/20	0.88
日本	国債証券	第３６９回利付国債（１０年）	1,650,000,000	97.94	1,616,095,900	99.48	1,641,552,000	0.500000	2032/12/20	0.86
日本	国債証券	第３６３回利付国債（１０年）	1,670,000,000	96.47	1,611,049,000	97.68	1,631,356,200	0.100000	2031/6/20	0.85
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	1,600,000,000	99.41	1,590,706,600	99.46	1,591,408,000	0.100000	2028/9/20	0.83
日本	国債証券	第３６０回利付国債（１０年）	1,570,000,000	97.39	1,529,053,200	98.49	1,546,293,000	0.100000	2030/9/20	0.81
日本	国債証券	第３６６回利付国債（１０年）	1,580,000,000	96.19	1,519,940,800	97.67	1,543,233,400	0.200000	2032/3/20	0.80
日本	国債証券	第３６４回利付国債（１０年）	1,570,000,000	96.01	1,507,360,800	97.39	1,529,054,400	0.100000	2031/9/20	0.80
日本	国債証券	第４５３回利付国債（２年）	1,470,000,000	99.80	1,467,081,300	99.97	1,469,603,100	0.005000	2025/10/1	0.77
日本	国債証券	第３６２回利付国債（１０年）	1,450,000,000	97.61	1,415,404,000	97.96	1,420,521,500	0.100000	2031/3/20	0.74
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	1,400,000,000	100.02	1,400,296,000	99.74	1,396,486,000	0.100000	2028/3/20	0.73
日本	国債証券	第３６７回利付国債（１０年）	1,240,000,000	96.16	1,192,458,500	97.40	1,207,846,800	0.200000	2032/6/20	0.63
日本	国債証券	第３４９回利付国債（１０年）	1,200,000,000	100.16	1,201,920,000	99.92	1,199,052,000	0.100000	2027/12/20	0.63
日本	国債証券	第１４３回利付国債（２０年）	1,080,000,000	111.68	1,206,156,500	109.15	1,178,841,600	1.600000	2033/3/20	0.61
日本	国債証券	第１１６回利付国債（２０年）	1,050,000,000	113.85	1,195,467,000	111.81	1,174,036,500	2.200000	2030/3/20	0.61
日本	国債証券	第１４７回利付国債（２０年）	1,050,000,000	109.04	1,144,962,000	109.19	1,146,516,000	1.600000	2033/12/20	0.60
日本	国債証券	第３６５回利付国債（１０年）	1,160,000,000	96.91	1,124,156,000	97.12	1,126,638,400	0.100000	2031/12/20	0.59

（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

2023年12月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	82.74
地方債証券	5.33
特殊債券	4.78
社債券	6.72
合計	99.56

（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

2023年12月29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 2 4 年 0 3 月 限	買建	2	円	291,201,870	293,420,000	0.15

（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。

日本短期債券マザーファンド

投資状況

2023年12月29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	11,997,598,000	59.28
地方債証券	日本	99,908,000	0.49
特殊債券	日本	700,529,000	3.46
社債券	日本	6,699,832,150	33.11
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	739,448,839	3.66
純資産総額		20,237,315,989	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

2023年12月29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 4 5 2 回 利付 国債（2 年）	2,700,000,000	99.96	2,699,015,000	99.99	2,699,757,000	0.005000	2025/9/1	13.34
日本	国債証券	第 4 4 9 回 利付 国債（2 年）	2,000,000,000	99.96	1,999,240,000	100.02	2,000,420,000	0.005000	2025/6/1	9.88
日本	国債証券	第 4 5 3 回 利付 国債（2 年）	2,000,000,000	99.94	1,998,880,000	99.97	1,999,460,000	0.005000	2025/10/1	9.88
日本	国債証券	第 4 5 6 回 利付 国債（2 年）	1,500,000,000	100.10	1,501,605,000	100.10	1,501,635,000	0.100000	2026/1/1	7.42

日本	国債証券	第４５５回利付国債（２年）	1,400,000,000	99.82	1,397,493,000	99.96	1,399,454,000	0.005000	2025/12/1	6.92
日本	国債証券	第１５０回利付国債（５年）	1,000,000,000	99.83	998,320,000	99.85	998,520,000	0.005000	2026/12/20	4.93
日本	国債証券	第１５１回利付国債（５年）	500,000,000	99.79	498,955,000	99.80	499,040,000	0.005000	2027/3/20	2.47
日本	国債証券	第１５３回利付国債（５年）	500,000,000	99.43	497,190,000	99.72	498,620,000	0.005000	2027/6/20	2.46
日本	国債証券	第４５４回利付国債（２年）	400,000,000	100.12	400,480,000	100.17	400,692,000	0.100000	2025/11/1	1.98
日本	特殊債券	第７２回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	200,000,000	100.65	201,308,000	100.54	201,094,000	0.529000	2025/5/28	0.99
日本	社債券	第２４回ルノー	200,000,000	100.54	201,089,000	100.38	200,766,000	1.540000	2024/7/5	0.99
日本	社債券	第１２回ロイズ・バンキング・グループ期限前償還条項付	200,000,000	100.00	200,000,000	100.05	200,100,000	1.377000	2027/12/1	0.99
日本	社債券	第１８４回東日本旅客鉄道	200,000,000	99.87	199,746,000	99.91	199,838,000	0.210000	2025/10/14	0.99
日本	特殊債券	第９９回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	200,000,000	99.73	199,464,000	99.87	199,744,000	0.225000	2027/8/27	0.99
日本	社債券	第４８３回東北電力	200,000,000	99.94	199,880,000	99.86	199,736,000	0.300000	2026/5/25	0.99
日本	社債券	第２２回大和ハウス工業（グリーン）	200,000,000	99.69	199,384,000	99.83	199,666,000	0.130000	2025/9/12	0.99
日本	社債券	第１２回アサヒグループホールディングス	200,000,000	99.47	198,948,000	99.75	199,518,000	0.330000	2027/6/11	0.99
日本	社債券	第１回サンタンデール銀行（２０１９）	200,000,000	99.88	199,774,000	99.75	199,512,000	0.463000	2024/12/5	0.99
日本	特殊債券	第２８７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	99.78	199,566,000	99.71	199,438,000	0.091000	2026/9/11	0.99
日本	社債券	第８１回ホンダファイナンス	200,000,000	99.29	198,586,000	99.53	199,062,000	0.389000	2028/6/20	0.98
日本	社債券	第１８回デンソー	200,000,000	99.44	198,882,000	99.44	198,884,000	0.315000	2028/3/17	0.98
日本	社債券	第１９回三井住友信託銀行	200,000,000	99.52	199,042,000	99.44	198,882,000	0.140000	2026/4/28	0.98
日本	社債券	第１７回イオンフィナンシャルサービス	200,000,000	99.18	198,364,000	99.43	198,864,000	0.340000	2026/7/31	0.98
日本	社債券	第１５回セブン＆アイ・ホールディングス	200,000,000	99.23	198,476,000	99.36	198,720,000	0.280000	2027/12/20	0.98
日本	社債券	第１９回日立製作所	200,000,000	99.09	198,184,000	99.25	198,514,000	0.160000	2027/3/12	0.98
日本	社債券	第５０８回関西電力	105,000,000	99.56	104,539,050	99.98	104,982,150	0.455000	2027/4/23	0.52
日本	社債券	第２７回野村ホールディングス	100,000,000	103.46	103,466,000	102.58	102,585,000	2.107000	2025/9/24	0.51
日本	社債券	第１２回セブン＆アイ・ホールディングス	100,000,000	100.90	100,904,000	100.80	100,801,000	0.781000	2025/6/20	0.50
日本	社債券	第６３回神戸製鋼所	100,000,000	100.80	100,804,000	100.69	100,697,000	0.924000	2025/5/21	0.50
日本	社債券	第６９回アコム	100,000,000	100.89	100,890,000	100.68	100,684,000	1.210000	2024/9/26	0.50

（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

2023年12月29日現在

種類	投資比率（％）
----	---------

国債証券	59.28
地方債証券	0.49
特殊債券	3.46
社債券	33.11
合計	96.35

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

2023年12月29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	237,782,196,021	46.03
	フランス	43,375,040,388	8.40
	イタリア	38,830,566,166	7.52
	中国	38,210,120,427	7.40
	ドイツ	31,940,165,030	6.18
	イギリス	27,016,042,469	5.23
	スペイン	26,745,460,579	5.18
	カナダ	10,224,741,278	1.98
	ベルギー	9,204,104,483	1.78
	オランダ	7,739,240,986	1.50
	オーストラリア	7,145,760,117	1.38
	オーストリア	6,208,254,548	1.20
	メキシコ	4,591,132,739	0.89
	アイルランド	2,996,457,556	0.58
	フィンランド	2,660,232,772	0.51
	ポーランド	2,583,303,147	0.50
	マレーシア	2,573,047,033	0.50
	シンガポール	2,187,594,873	0.42
	イスラエル	1,522,502,924	0.29
	デンマーク	1,393,288,661	0.27
	ニュージーランド	1,227,864,889	0.24
	スウェーデン	995,943,860	0.19
	ノルウェー	857,734,147	0.17
	小計	508,010,795,093	98.34
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	8,587,312,206	1.66
純資産総額		516,598,107,299	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

2023年12月29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	3.875 T-NOTE 330815	16,640,000	13,479.48	2,242,987,114	14,216.24	2,365,582,565	3.875000	2033/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	3.375 T-NOTE 330515	16,100,000	13,652.64	2,198,075,166	13,657.78	2,198,903,510	3.375000	2033/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	4.125 T-NOTE 321115	15,100,000	15,009.16	2,266,383,172	14,462.78	2,183,880,051	4.125000	2032/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 311115	18,100,000	12,103.67	2,190,766,078	11,810.39	2,137,681,416	1.375000	2031/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 310815	17,720,000	12,064.96	2,137,912,394	11,768.56	2,085,389,857	1.250000	2031/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	3.5 T-NOTE 330215	15,100,000	14,308.20	2,160,539,592	13,799.33	2,083,700,157	3.500000	2033/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	1.875 T-NOTE 320215	16,860,000	12,506.66	2,108,623,770	12,229.51	2,061,895,940	1.875000	2032/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 320515	15,480,000	13,612.42	2,107,204,070	13,182.71	2,040,683,621	2.875000	2032/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 310515	16,640,000	12,478.79	2,076,471,644	12,192.94	2,028,906,516	1.625000	2031/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 320815	15,460,000	13,362.73	2,065,879,142	13,029.52	2,014,364,298	2.750000	2032/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	0.875 T-NOTE 301115	16,730,000	11,920.81	1,994,351,764	11,675.21	1,953,263,111	0.875000	2030/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 310215	16,360,000	11,982.91	1,960,404,754	11,860.53	1,940,383,322	1.125000	2031/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300815	16,160,000	11,684.17	1,888,162,187	11,521.74	1,861,914,541	0.625000	2030/8/15	0.36
フランス	国債証券	2.75 O.A.T 271025	10,320,000	15,862.45	1,637,005,498	16,038.65	1,655,188,936	2.750000	2027/10/25	0.32
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 250815	11,490,000	13,635.62	1,566,733,294	13,642.82	1,567,560,834	2.000000	2025/8/15	0.30
フランス	国債証券	2.5 O.A.T 300525	9,590,000	15,644.31	1,500,289,588	15,994.70	1,533,892,307	2.500000	2030/5/25	0.30
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 270131	11,540,000	13,212.35	1,524,705,298	13,154.45	1,518,024,165	1.500000	2027/1/31	0.29
アメリカ	国債証券	4.125 T-BOND 530815	10,020,000	13,095.69	1,312,188,592	14,478.84	1,450,780,626	4.125000	2053/8/15	0.28
フランス	国債証券	0.75 O.A.T 280525	9,750,000	14,378.21	1,401,876,019	14,793.94	1,442,409,915	0.750000	2028/5/25	0.28
フランス	国債証券	1.5 O.A.T 310525	9,560,000	14,445.52	1,380,992,030	14,924.56	1,426,788,098	1.500000	2031/5/25	0.28
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 251115	10,290,000	13,687.14	1,408,407,630	13,655.29	1,405,129,618	2.250000	2025/11/15	0.27
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300515	12,090,000	11,787.95	1,425,163,956	11,607.62	1,403,361,507	0.625000	2030/5/15	0.27
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280815	10,310,000	13,762.25	1,418,888,388	13,570.80	1,399,149,905	2.875000	2028/8/15	0.27
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280515	10,090,000	13,823.95	1,394,837,386	13,600.72	1,372,312,781	2.875000	2028/5/15	0.27
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 261031	10,450,000	13,053.70	1,364,112,276	13,080.77	1,366,940,507	1.125000	2026/10/31	0.26
アメリカ	国債証券	5 T-NOTE 251031	9,500,000	14,212.82	1,350,218,055	14,339.23	1,362,227,282	5.000000	2025/10/31	0.26
アメリカ	国債証券	0.25 T-NOTE 251031	10,300,000	13,034.23	1,342,525,942	13,164.42	1,355,936,068	0.250000	2025/10/31	0.26
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 280215	9,990,000	13,786.87	1,377,308,632	13,558.89	1,354,533,364	2.750000	2028/2/15	0.26
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 280930	10,700,000	12,690.94	1,357,931,479	12,568.02	1,344,778,315	1.250000	2028/9/30	0.26

アメリカ	国債証券	0.375 T-NOTE 251130	10,150,000	13,050.02	1,324,577,243	13,161.38	1,335,880,149	0.375000	2025/11/30	0.26
------	------	------------------------	------------	-----------	---------------	-----------	---------------	----------	------------	------

（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

2023年12月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.34
合計	98.34

（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。

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

2023年12月29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	146,280,365,642	45.03
	フランス	26,482,204,383	8.15
	イタリア	23,764,579,225	7.32
	中国	23,460,463,734	7.22
	ドイツ	20,824,139,491	6.41
	イギリス	16,421,298,544	5.05
	スペイン	15,400,115,531	4.74
	カナダ	6,179,887,592	1.90
	ベルギー	5,639,731,988	1.74
	オランダ	4,806,283,838	1.48
	オーストラリア	4,519,770,191	1.39
	オーストリア	3,758,249,509	1.16
	メキシコ	2,773,115,349	0.85
	アイルランド	1,846,012,339	0.57
	フィンランド	1,692,844,939	0.52
	ポーランド	1,627,068,620	0.50
	マレーシア	1,592,577,017	0.49
	シンガポール	1,303,221,208	0.40
	イスラエル	934,988,809	0.29
	デンマーク	909,580,046	0.28
	ニュージーランド	712,646,874	0.22
	スウェーデン	651,375,131	0.20
	ノルウェー	545,890,141	0.17
	小計	312,126,410,141	96.08

コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	12,728,998,783	3.92
純資産総額		324,855,408,924	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

2023年12月29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	4.125 T-NOTE 321115	10,640,000	15,004.19	1,596,446,422	14,462.78	1,538,839,982	4.125000	2032/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 320815	10,600,000	13,326.71	1,412,631,693	13,029.52	1,381,129,466	2.750000	2032/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	3.5 T-NOTE 330215	9,650,000	13,990.75	1,350,107,569	13,799.33	1,331,636,193	3.500000	2033/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	3.375 T-NOTE 330515	9,730,000	13,673.21	1,330,403,545	13,657.78	1,328,902,555	3.375000	2033/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 310815	11,260,000	11,937.83	1,344,199,782	11,768.56	1,325,140,508	1.250000	2031/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 320515	9,900,000	13,594.40	1,345,846,144	13,182.71	1,305,088,362	2.875000	2032/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300815	11,200,000	11,623.24	1,301,803,675	11,521.74	1,290,435,820	0.625000	2030/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	1.875 T-NOTE 320215	10,400,000	12,452.67	1,295,078,096	12,229.51	1,271,869,381	1.875000	2032/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 310515	10,280,000	12,300.86	1,264,528,481	12,192.94	1,253,435,035	1.625000	2031/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 311115	10,390,000	12,030.02	1,249,919,140	11,810.39	1,227,099,995	1.375000	2031/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 310215	10,300,000	12,011.58	1,237,193,018	11,860.53	1,221,634,976	1.125000	2031/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	0.875 T-NOTE 301115	10,300,000	11,625.23	1,197,399,066	11,675.21	1,202,546,923	0.875000	2030/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	3.875 T-NOTE 330815	8,010,000	13,432.45	1,075,939,573	14,216.24	1,138,720,932	3.875000	2033/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 280630	8,170,000	12,408.23	1,013,752,759	12,645.86	1,033,166,918	1.250000	2028/6/30	0.32
アメリカ	国債証券	4.125 T-NOTE 250131	7,200,000	14,225.54	1,024,239,528	14,090.20	1,014,494,475	4.125000	2025/1/31	0.31
アメリカ	国債証券	3.125 T-NOTE 250815	7,300,000	13,967.49	1,019,627,217	13,894.63	1,014,308,050	3.125000	2025/8/15	0.31
フランス	国債証券	2.5 O.A.T 300525	6,300,000	15,688.43	988,371,216	15,994.70	1,007,666,479	2.500000	2030/5/25	0.31
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 280531	7,950,000	12,702.29	1,009,832,437	12,666.63	1,006,997,712	1.250000	2028/5/31	0.31
アメリカ	国債証券	4.625 T-NOTE 250228	7,000,000	14,235.47	996,483,397	14,176.35	992,344,620	4.625000	2025/2/28	0.31
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300515	8,200,000	11,574.37	949,099,130	11,607.62	951,825,010	0.625000	2030/5/15	0.29
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 270131	7,200,000	13,102.25	943,362,389	13,154.45	947,120,796	1.500000	2027/1/31	0.29
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 280930	7,300,000	12,519.82	913,946,985	12,568.02	917,465,580	1.250000	2028/9/30	0.28
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 280215	6,650,000	13,649.47	907,690,113	13,558.89	901,666,353	2.750000	2028/2/15	0.28
フランス	国債証券	0.75 O.A.T 280525	6,070,000	14,370.08	872,263,898	14,793.94	897,992,634	0.750000	2028/5/25	0.28
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280515	6,600,000	13,669.48	902,186,303	13,600.72	897,647,607	2.875000	2028/5/15	0.28
フランス	国債証券	1.5 O.A.T 310525	5,870,000	14,516.31	852,107,797	14,924.56	876,071,772	1.500000	2031/5/25	0.27

アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 251115	6,400,000	13,570.80	868,531,464	13,655.29	873,938,731	2.250000	2025/11/15	0.27
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 260731	6,700,000	12,830.56	859,647,540	12,984.37	869,952,808	0.625000	2026/7/31	0.27
アメリカ	国債証券	0.375 T-NOTE 260131	6,600,000	12,797.66	844,645,851	13,093.51	864,171,848	0.375000	2026/1/31	0.27
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 280831	6,900,000	12,531.62	864,682,128	12,520.65	863,925,035	1.125000	2028/8/31	0.27

（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

2023年12月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	96.08
合計	96.08

（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。

新マネー・マーケット・マザーファンド

投資状況

2023年12月29日現在

（単位：円）

資産の種類	国 / 地域	時価合計	投資比率（％）
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	2,399,261,971	100.00
純資産総額		2,399,261,971	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

該当事項はありません。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

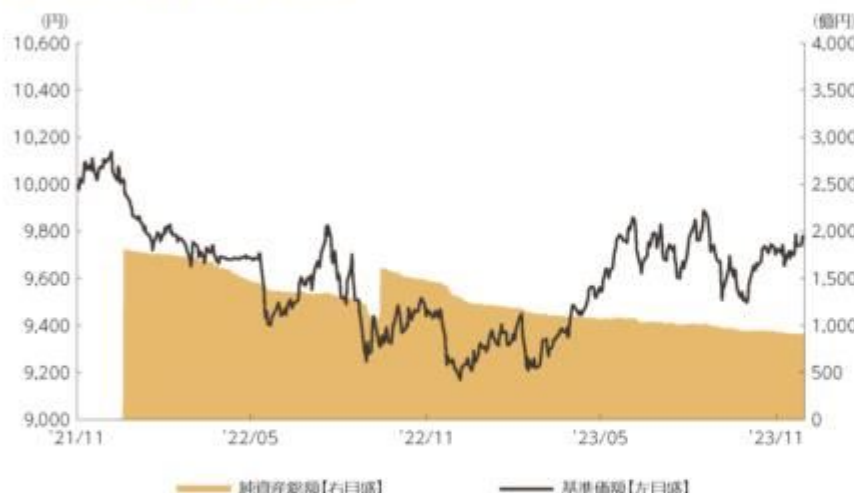
参考情報



運用実績

2023年12月29日現在

■基準価額・純資産の推移 2021年11月30日(設定日)～2023年12月29日



■基準価額・純資産

基準価額	9,770円
純資産総額	903.3億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2023年6月	0円
2022年6月	0円
設定来累計	0円

●分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

資産別構成	比率	組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	種類	業種／種別	国・地域	比率
国内株式	12.2%	1 円	67.6%	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェア／機器	アメリカ	1.1%
国内債券	24.2%	2 アメリカドル	21.0%	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.9%
外国株式	19.9%	3 ユーロ	5.8%	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	日本	0.5%
外国債券	20.0%	4 イギリスポンド	1.5%	AMAZON.COM INC	株式	一般消費サービス流通・小売	アメリカ	0.5%
		5 カナダドル	0.9%	NVIDIA CORP	株式	半導体・半導体製造装置	アメリカ	0.4%
		6 中国元	0.8%	第452回利付国債(2年)	債券	国債	日本	2.7%
		7 オーストラリアドル	0.6%	第453回利付国債(2年)	債券	国債	日本	2.0%
		8 スイスフラン	0.6%	第449回利付国債(2年)	債券	国債	日本	2.0%
コールローン他 (負債控除後)	23.7%	9 デンマーククローネ	0.2%	第456回利付国債(2年)	債券	国債	日本	1.5%
合計	100.0%	10 スウェーデンクローネ	0.2%	第455回利付国債(2年)	債券	国債	日本	1.4%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引（買建）	1.2%
債券先物取引（買建）	0.0%

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

■年間収益率の推移



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。

1【申込（販売）手続等】

<訂正前>

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

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

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。

申込単位

販売会社が定める単位

申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

申込単位・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ください。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

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/>

申込手数料

ありません。

申込方法

取得申込者は、販売会社取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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には販売会社により異なる場合があります。

申込受付時間

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

取得申込みの受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、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。

< 訂正後 >

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

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

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。

申込単位

販売会社が定める単位

申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

申込単位・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ください。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

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/>

申込手数料

ありません。

申込方法

取得申込者は、販売会社取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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の販売会社により異なる場合があります。

申込受付時間

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

取得申込みの受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、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】

<訂正前>

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

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

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。

解約単位

販売会社が定める単位

解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

信託財産留保額

ありません。

解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

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/>

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6営業日目から販売会社において支払います。

解約請求受付時間

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

解約請求受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求の受付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。

<訂正後>

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

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

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。

解約単位

販売会社が定める単位

解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

信託財産留保額

ありません。

解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

支払開始日

解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して6営業日目から販売会社において支払います。

解約請求受付時間

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

解約請求受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求の受付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】

<訂正前>

基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

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

（資産の評価方法）

・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券

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

・転換社債／転換社債型新株予約権付社債

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

・公社債等

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

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

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・外貨建資産

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

・外国為替予約取引

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

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

<訂正後>

基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

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

（資産の評価方法）

・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券

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

・転換社債／転換社債型新株予約権付社債

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

・公社債等

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

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

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・外貨建資産

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

・外国為替予約取引

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

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

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/>

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2023年6月27日から2023年12月26日まで）の中間財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 [2023年 6月26日現在]	第3期中間計算期間末 [2023年12月26日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,505,520,767	18,731,449,147
親投資信託受益証券	104,869,592,625	69,491,876,097
未収入金	-	2,740,870,000
流動資産合計	107,375,113,392	90,964,195,244
資産合計	107,375,113,392	90,964,195,244
負債の部		
流動負債		
未払解約金	482,223,909	438,896,149
未払受託者報酬	15,638,525	13,516,252
未払委託者報酬	84,447,980	72,987,693
未払利息	6,297	5,316
その他未払費用	1,939,124	1,675,958
流動負債合計	584,255,835	527,081,368
負債合計	584,255,835	527,081,368
純資産の部		
元本等		
元本	109,425,362,504	92,821,687,300
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,634,504,947	2,384,573,424
（分配準備積立金）	1,420,806,813	1,203,027,660
元本等合計	106,790,857,557	90,437,113,876
純資産合計	106,790,857,557	90,437,113,876
負債純資産合計	107,375,113,392	90,964,195,244

（2）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 2022年 6月28日 至 2022年12月27日	第3期中間計算期間 自 2023年 6月27日 至 2023年12月26日
営業収益		
受取利息	44,364	139,850
有価証券売買等損益	2,639,903,320	157,776,528
営業収益合計	2,639,858,956	157,636,678

	第2期中間計算期間 自 2022年 6月28日 至 2022年12月27日	第3期中間計算期間 自 2023年 6月27日 至 2023年12月26日
営業費用		
支払利息	4,111,878	3,651,995
受託者報酬	18,953,030	13,516,252
委託者報酬	102,346,293	72,987,693
その他費用	2,350,112	1,675,958
営業費用合計	127,761,313	91,831,898
営業利益又は営業損失（ ）	2,767,620,269	249,468,576
経常利益又は経常損失（ ）	2,767,620,269	249,468,576
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,767,620,269	249,468,576
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	378,832,359	98,889,586
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	7,490,108,011	2,634,504,947
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,344,861,184	404,251,281
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,344,861,184	404,251,281
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,078,292,437	3,740,768
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,078,292,437	3,740,768
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	10,612,327,174	2,384,573,424

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年6月25日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当中間計算期間は2023年 6月27日から2023年12月26日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

	第2期 [2023年 6月26日現在]	第3期中間計算期間末 [2023年12月26日現在]
1. 期首元本額	143,656,913,962円	109,425,362,504円
期中追加設定元本額	59,952,533,967円	191,130,193円
期中一部解約元本額	94,184,085,425円	16,794,805,397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。	2,634,504,947円	2,384,573,424円
3. 受益権の総数	109,425,362,504口	92,821,687,300口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

第2期中間計算期間 自 2022年 6月28日 至 2022年12月27日	第3期中間計算期間 自 2023年 6月27日 至 2023年12月26日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	第2期 [2023年 6月26日現在]	第3期中間計算期間末 [2023年12月26日現在]
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品	（１）有価証券 同左 （２）デリバティブ取引 同左 （３）上記以外の金融商品

区分	第2期 [2023年 6月26日現在]	第3期中間計算期間末 [2023年12月26日現在]
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価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 同左

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	第2期 [2023年 6月26日現在]	第3期中間計算期間末 [2023年12月26日現在]
1口当たり純資産額	0.9759円	0.9743円
(1万口当たり純資産額)	(9,759円)	(9,743円)

（追加情報）

第2期中間計算期間 自 2022年 6月28日 至 2022年12月27日	第3期中間計算期間 自 2023年 6月27日 至 2023年12月26日
当ファンドは、主要投資対象の変更を行うことを2022年 8月30日付で社内規定に基づき決裁しました。 当ファンドは、2022年10月 6日付で「国内債券インデックスマザーファンド」、「外国債券インデックスマザーファンド」および「ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド」を新たな主要投資対象として追加し、マザーファンドへの投資を通じて、わが国の社債および先進国の公社債にも投資を行います。	—

（参考）

当ファンドの主要投資対象の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

ＴＯＰＩＸマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[2023年12月26日現在]	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	36,663,438,733
株式	1,153,517,896,000
派生商品評価勘定	13,389,700
未収配当金	88,240,975
未収利息	460,726
その他未収収益	9,067,519
差入委託証拠金	141,276,422
流動資産合計	1,190,433,770,075
資産合計	1,190,433,770,075
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,610,150
前受金	5,820,000
未払金	86,338,970

[2023年12月26日現在]

未払解約金	879,222,352
未払利息	10,406
受入担保金	32,144,817,479
流動負債合計	33,123,819,357
負債合計	33,123,819,357
純資産の部	
元本等	
元本	408,243,703,719
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	749,066,246,999
元本等合計	1,157,309,950,718
純資産合計	1,157,309,950,718
負債純資産合計	1,190,433,770,075

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 新株予約権証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[2023年12月26日現在]
1. 期首	2023年 6月27日
期首元本額	402,039,788,052円
期中追加設定元本額	75,605,322,802円
期中一部解約元本額	69,401,407,135円
元本の内訳	
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスオープン	6,761,406,603円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）	834,051,703円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）	3,708,642,051円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）	3,548,382,099円
三菱ＵＦＪ トピックスオープン（確定拠出年金）	3,549,681,939円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	6,333,317,683円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	35,330,655,797円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	41,791,715,828円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	95,313,613円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド（成長型）	258,682,039円
ファンド・マネジャー（国内株式）	552,512,574円
eMAXIS TOPIXインデックス	7,257,279,508円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	2,117,488,049円
eMAXIS バランス（波乗り型）	139,862,912円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	2,818,671,337円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	896,341,296円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	1,119,934,973円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	1,076,809,855円
eMAXIS Slim 国内株式（TOPIX）	36,067,297,614円
国内株式セレクション（ラップ向け）	4,678,201,531円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	10,264,141,927円
つみたて日本株式（TOPIX）	8,507,283,255円
つみたて8資産均等バランス	5,029,385,312円
つみたて4資産均等バランス	1,781,977,490円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	2,782,655円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	4,725,839円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	7,883,493円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	735,847,525円

	[2023年12月26日現在]
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４５（確定拠出年金）	919,656,068円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５５（確定拠出年金）	654,675,135円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式１５）	550,558,517円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式４０）	1,732,699,572円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式６５）	3,908,157,130円
eMAXIS Slim 全世界株式（３地域均等型）	1,136,828,827円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金インデックス（国内株式）	3,890,269,866円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金）	574,583,228円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式２５）	162,752,335円
国内株式インデックス・オープン（ラップ向け）	19,158,294,975円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６５（確定拠出年金）	261,038,169円
ラップ向けインデックスf 国内株式	3,934,851,968円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）	160,349,292円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）	2,710,125,103円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（積極型）	1,433,016,794円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式８０）	39,274,790円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	3,846,127,133円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	76,310,403円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	21,882,456円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	33,562,885円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０７０（確定拠出年金）	1,641,654円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	1,056,568,013円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	2,305,925,531円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	144,562,547円
三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	1,285,924,652円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	363,642,359円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	16,852,005円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	111,980,524円
eMAXIS バランス（４資産均等型）	716,939,880円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	135,856,906円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	165,346,413円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	604,414,387円
eMAXIS 最適化バランス（マイフoward）	505,894,623円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	999,838,299円
三菱ＵＦＪ トピックスオープン	1,000,132,033円
三菱ＵＦＪ ＤＣトピックスオープン	7,931,021,394円
三菱ＵＦＪ トピックスオープンVA（適格機関投資家限定）	53,744,166円
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスファンドVA（適格機関投資家限定）	4,459,343,379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）	599円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５VA（適格機関投資家限定）	7,843,427円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０VA（適格機関投資家限定）	4,045,218,577円
三菱ＵＦＪ バランスファンドVA ２０型（適格機関投資家限定）	74,027,347円
三菱ＵＦＪ バランスファンドVA ４０型（適格機関投資家限定）	1,330,083,671円
MUAM 日本株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	41,882,225,359円
三菱ＵＦＪ バランスファンドVA ５０型（適格機関投資家限定）	207,209,164円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５VA（適格機関投資家限定）	225,928円
三菱ＵＦＪ バランスファンドVA ３０型（適格機関投資家限定）	134,400円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	213,774,873円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０VA（適格機関投資家限定）	373,202,972円
MUAM インデックスファンドTOPIXi（適格機関投資家限定）	4,080,293,603円
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	3,287,200,901円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	990,035,652円

	[2023年12月26日現在]
MUKAM スマート・クオリティ・セクション（適格機関投資家転売制限付）	522,372,720円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	85,271,699円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	2,836,290,324円
MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	180,311,996円
MUKAM 日本株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	3,179,774,647円
MUKAM スマート・クオリティ・セクション2（適格機関投資家限定）	327,721,170円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	16,468,253,190円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付）	88,085,272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）	310,244円
日米コアバランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	123,455,867円
日本株式インデックスファンドS	2,298,503,453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）	35,980,732円
MUKAM 米国国債プラス日本株式ファンド2020-07（適格機関投資家限定）	94,510,806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）	35,434,968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）	35,501,352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）	35,160,631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）	35,822,253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）	35,950,680円
MUKAM 日米コアバランス 2021-07（適格機関投資家限定）	331,732,772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）	34,885,307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）	34,844,004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）	35,768,349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）	35,818,860円
MUKAM 日米コアバランス（除く米国株）2022-03（適格機関投資家限定）	691,350,540円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03（適格機関投資家限定）	40,180,532円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05（適格機関投資家限定）	39,815,667円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07（適格機関投資家限定）	40,598,807円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09（適格機関投資家限定）	40,095,797円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11（適格機関投資家限定）	34,367,095円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01（適格機関投資家限定）	39,980,785円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03（適格機関投資家限定）	34,332,624円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05（適格機関投資家限定）	35,329,633円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	5,548,050,788円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	2,852,714円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	7,168,672円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	1,546,008円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	6,530,662円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	473,668,281円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	81,474,582円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	3,143,007円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	26,263,472円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	1,493,941円

[2023年12月26日現在]	
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	14,975,151円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>ＴＯＰＩＸ・ファンド	1,571,366,754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）	348,409,180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）	1,489,052,683円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	1,417,623,673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）	1,327,393,726円
三菱ＵＦＪ ＤＣ国内株式インデックスファンド	59,208,481,265円
合計	408,243,703,719円
2. 貸付有価証券 貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っております。 株式	30,641,477,870円
3. 受益権の総数	408,243,703,719口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

区分	[2023年12月26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（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）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

[2023年12月26日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,105,560,000	—	5,111,460,000	5,900,000
合計		5,105,560,000	—	5,111,460,000	5,900,000

（注）時価の算定方法

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

（１口当たり情報）

	[2023年12月26日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.8349円 (28,349円)

外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[2023年12月26日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	48,848,924,467
コール・ローン	7,900,801,881
株式	3,345,307,112,722
投資証券	70,284,988,755
派生商品評価勘定	2,871,822,727
未収入金	2,011,508,137
未収配当金	2,714,644,214
差入委託証拠金	115,121,605,430
流動資産合計	3,595,061,408,333
資産合計	3,595,061,408,333
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	174,601,462
未払解約金	4,958,511,121
未払利息	2,242
流動負債合計	5,133,114,825
負債合計	5,133,114,825
純資産の部	
元本等	
元本	608,850,753,771
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,981,077,539,737
元本等合計	3,589,928,293,508
純資産合計	3,589,928,293,508
負債純資産合計	3,595,061,408,333

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 投資証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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。

（貸借対照表に関する注記）

	[2023年12月26日現在]
1. 期首	2023年 6月27日
期首元本額	513,699,458,357円
期中追加設定元本額	135,654,501,232円
期中一部解約元本額	40,503,205,818円
元本の内訳	
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）	194,116,940円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）	944,886,493円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）	877,466,942円
MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信	2,983,239,173円
MAXIS 全世界株式（オール・カントリー）上場投信	4,770,897,588円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	1,474,012,599円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	9,001,528,496円

	[2023年12月26日現在]
三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	10,334,524,951円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）	46,664,592円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）	124,116,229円
ファンド・マネジャー（海外株式）	778,622円
eMAXIS 先進国株式インデックス	13,848,592,120円
eMAXIS バランス（８資産均等型）	1,021,268,277円
eMAXIS バランス（波乗り型）	182,153,639円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	1,742,545,613円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３０（確定拠出年金）	216,421,078円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４０（確定拠出年金）	280,596,227円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５０（確定拠出年金）	252,368,165円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	98,165,014,791円
海外株式セレクション（ラップ向け）	2,629,117,013円
eMAXIS Slim バランス（８資産均等型）	4,989,069,626円
つみたて先進国株式	29,927,822,919円
つみたて８資産均等バランス	2,428,467,790円
つみたて４資産均等バランス	857,535,118円
eMAXIS マイマネージャー １９７０ｓ	2,021,765円
eMAXIS マイマネージャー １９８０ｓ	3,552,719円
eMAXIS マイマネージャー １９９０ｓ	5,722,581円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３５（確定拠出年金）	177,201,203円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４５（確定拠出年金）	222,793,440円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５５（確定拠出年金）	153,818,941円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式１５）	68,072,550円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式４０）	514,166,804円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式６５）	1,373,355,921円
eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）	53,674,464,213円
eMAXIS Slim 全世界株式（３地域均等型）	547,340,050円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金インデックス（先進国株式）	4,297,357,242円
eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）	256,027,736,979円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金）	141,011,364円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式２５）	45,277,183円
つみたて全世界株式	578,496,472円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６５（確定拠出年金）	63,978,829円
ラップ向けインデックスf 先進国株式	2,614,305,463円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式８０）	42,733,373円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	3,212,468,918円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	64,984,696円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０７０（確定拠出年金）	410,879円
三菱ＵＦＪ ＤＣ海外株式インデックスファンド	32,151,241,068円
eMAXIS 全世界株式インデックス	5,440,976,375円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	597,171,787円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	1,169,481,285円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	175,308,769円
三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	727,020,996円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	178,129,075円
eMAXIS バランス（４資産均等型）	344,436,883円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	81,857,068円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	113,264,195円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	473,166,941円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	378,896,882円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	733,613,739円
三菱ＵＦＪ 外国株式ファンドVA（適格機関投資家限定）	1,299,782,285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）	153円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５VA（適格機関投資家限定）	4,855,083円

	[2023年12月26日現在]
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,309,852,428円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	36,366,902円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	652,321,882円
ＭＵＡＭ 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	8,736,859,610円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	66,355円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	525,981,155円
ＭＵＡＭ 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	4,902,018,210円
アドバンスト・バランス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	9,840,322円
アドバンスト・バランス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	62,127,885円
ＭＵＫＡＭ バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	1,863,070,952円
ＭＵＫＡＭ バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	560,001,558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）	176,899,287円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	52,716,268円
ＭＵＫＡＭ 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	1,765,377,303円
ＭＵＫＡＭ バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	88,203,913円
ＭＵＫＡＭ 外国株式インデックスファンド２（適格機関投資家限定）	2,294,179,188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）	115,839,520円
ＭＵＫＡＭ 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	8,835,067,515円
ＭＵＫＡＭ バランス・イノベーション（リスク抑制型）２（適格機関投資家転売制限付）	50,066,781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）	225,828円
外国株式インデックスファンドⅤ（適格機関投資家限定）	2,867,024,497円
海外株式インデックスファンドＳ	5,789,230,825円
外国株式インデックスオープンⅤ（適格機関投資家限定）	84,625,601円
全世界株式インデックスファンドⅤ（適格機関投資家限定）	43,676,495円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンド	2,863,952,311円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ⅤＡ	700,632円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ⅤＡ	1,754,575円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ⅤＡ	428,729円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ⅤＡ	1,985,242円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンドⅤＡ	21,251,278円
三菱ＵＦＪ バランスⅤＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	777,190円
三菱ＵＦＪ バランスⅤＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	6,442,142円
三菱ＵＦＪ バランスⅤＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	741,322円
三菱ＵＦＪ バランスⅤＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	7,203,303円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>外国株式インデックスファンド	6,890,470,409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）	84,830,799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）	361,285,454円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	392,348,308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）	401,262,627円
合計	608,850,753,771円
２．受益権の総数	608,850,753,771口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2023年12月26日現在]
１．貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
２．時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

区分	[2023年12月26日現在]
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記) に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
 該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

[2023年12月26日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	171,352,855,252	—	174,051,989,982	2,699,134,730
合計		171,352,855,252	—	174,051,989,982	2,699,134,730

（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

[2023年12月26日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	766,918,920	—	767,275,463	356,543
	カナダドル	376,810,785	—	376,600,185	210,600
	オーストラリアドル	233,342,068	—	233,668,923	326,855
	イギリスポンド	484,822,940	—	483,193,404	1,629,536
	スイスフラン	316,173,264	—	315,921,629	251,635
	香港ドル	54,430,896	—	53,995,484	435,412
	スウェーデンクローネ	113,932,214	—	114,960,841	1,028,627
	ノルウェークローネ	40,431,050	—	40,658,711	227,661
	デンマーククローネ	149,997,847	—	149,984,018	13,829
	ユーロ	1,199,319,969	—	1,198,275,147	1,044,822
	売建				
	アメリカドル	756,224,149	—	756,322,513	98,364
	カナダドル	23,768,874	—	23,815,516	46,642

	オーストラリアドル	21,350,169	—	21,389,440	39,271
	ユーロ	51,471,885	—	51,554,925	83,040
	合計	4,588,995,030	—	4,587,616,199	1,913,465

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（１口当たり情報）

	[2023年12月26日現在]
1口当たり純資産額	5.8962円
(1万口当たり純資産額)	(58,962円)

国内債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[2023年12月26日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	788,898,059
国債証券	159,553,694,800
地方債証券	10,206,939,970
特殊債券	9,159,919,584
社債券	12,867,294,100
派生商品評価勘定	1,758,130
未収入金	140,507,000
未収利息	230,110,466
前払費用	29,510,337
差入委託証拠金	3,769,457
流動資産合計	192,982,401,903
資産合計	192,982,401,903
負債の部	
流動負債	
前受金	2,020,000
未払解約金	205,115,398
未払利息	223
流動負債合計	207,135,621
負債合計	207,135,621
純資産の部	
元本等	
元本	206,781,797,065
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	14,006,530,783
元本等合計	192,775,266,282
純資産合計	192,775,266,282
負債純資産合計	192,982,401,903

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[2023年12月26日現在]
1. 期首	2023年 6月27日
期首元本額	242,658,034,853円
期中追加設定元本額	131,862,947,105円
期中一部解約元本額	167,739,184,893円
元本の内訳	
ファンド・マネジャー（国内債券）	20,709,769,878円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	4,826,156,130円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	96,176,963円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	13,632,911円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	22,338,001円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	6,781,793,894円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	617,167,576円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	679,534,737円
三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）	8,236,228,889円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	5,084,001,096円
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	21,133,194,036円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	6,351,593,399円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	20,358,076,237円
MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	2,612,579,711円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	108,689,277,031円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付）	570,276,576円
合計	206,781,797,065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。	14,006,530,783円
3. 受益権の総数	206,781,797,065口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2023年12月26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（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）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

債券関連

[2023年12月26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	291,200,000	—	292,960,000	1,760,000
合計		291,200,000	—	292,960,000	1,760,000

（注）時価の算定方法

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

（１口当たり情報）

	[2023年12月26日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9323円 (9,323円)

日本短期債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[2023年12月26日現在]	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	565,871,926
国債証券	8,994,713,000
地方債証券	99,914,000
特殊債券	700,181,000
社債券	6,298,840,250
未収利息	4,146,820
前払費用	3,559,479
流動資産合計	16,667,226,475
資産合計	16,667,226,475
負債の部	
流動負債	
未払解約金	8,571,784
未払利息	160
流動負債合計	8,571,944
負債合計	8,571,944
純資産の部	
元本等	
元本	14,840,989,467
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,817,665,064
元本等合計	16,658,654,531
純資産合計	16,658,654,531
負債純資産合計	16,667,226,475

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[2023年12月26日現在]
1. 期首	2023年 6月27日
期首元本額	1,434,595,979円

	[2023年12月26日現在]
期中追加設定元本額	13,599,856,278円
期中一部解約元本額	193,462,790円
元本の内訳	
三菱ＵＦＪ グローバル・エコ・ウォーター・ファンド	88,421円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	12,864,992,221円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	70,755,224円
日本短期債券ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	12,592,417円
日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）	103,080,267円
三菱ＵＦＪ 積立ファンド（日本バランス型）	1,062,744,941円
三菱ＵＦＪ 国内バランス２０	726,735,976円
合計	14,840,989,467円
２．受益権の総数	14,840,989,467口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2023年12月26日現在]
１．貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
２．時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
３．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[2023年12月26日現在]
1口当たり純資産額	1.1225円
(1万口当たり純資産額)	(11,225円)

外国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	[2023年12月26日現在]
資産の部	
流動資産	
預金	2,653,296,192
コール・ローン	2,109,710,932
国債証券	505,935,222,513
派生商品評価勘定	193,679
未収利息	3,503,559,151
前払費用	370,624,909
流動資産合計	514,572,607,376
資産合計	514,572,607,376
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	50,157,194
未払金	23,037,474

[2023年12月26日現在]

未払解約金	376,688,512
未払利息	598
流動負債合計	449,883,778
負債合計	449,883,778
純資産の部	
元本等	
元本	203,202,072,602
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	310,920,650,996
元本等合計	514,122,723,598
純資産合計	514,122,723,598
負債純資産合計	514,572,607,376

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。

（貸借対照表に関する注記）

	[2023年12月26日現在]
1. 期首	2023年 6月27日
期首元本額	188,907,060,645円
期中追加設定元本額	24,816,998,517円
期中一部解約元本額	10,521,986,560円
元本の内訳	
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）	279,084,470円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）	639,282,943円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）	403,694,814円
三菱ＵＦＪ 外国債券オープン	844,033,038円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	2,119,207,118円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	6,090,173,412円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	4,754,587,654円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	538,764,773円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド（成長型）	96,618,561円
ファンド・マネジャー（海外債券）	925,650,659円
eMAXIS 先進国債券インデックス	6,011,966,246円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	2,373,639,293円
eMAXIS バランス（波乗り型）	214,847,273円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	1,002,112,887円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	419,930,960円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	233,126,858円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	155,071,656円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	36,419,770,299円
海外債券セレクション（ラップ向け）	5,794,847,787円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	11,569,980,811円
つみたて8資産均等バランス	5,641,511,025円
つみたて4資産均等バランス	1,996,129,788円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	4,444,769円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	2,319,702円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	528,643円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	229,969,853円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	152,246,636円

	[2023年12月26日現在]
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５５（確定拠出年金）	85,414,092円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式１５）	782,951,124円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式４０）	1,182,759,506円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式６５）	1,755,106,528円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金インデックス（先進国債券）	1,997,227,484円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金）	71,123,656円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式２５）	173,588,227円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６５（確定拠出年金）	32,254,157円
ラップ向けインデックスｆ 先進国債券	2,739,807,658円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式８０）	26,809,609円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	4,021,839,748円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	76,839,332円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	40,233,091円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	61,764,089円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０７０（確定拠出年金）	201,354円
三菱ＵＦＪ 外国債券オープン（確定拠出年金）	3,095,610,860円
三菱ＵＦＪ 外国債券オープン（毎月分配型）	16,939,565,970円
ワールド・インカムオープン	1,002,089,144円
三菱ＵＦＪ ＤＣ海外債券インデックスファンド	15,463,879,263円
三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）	411,021,759円
三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド（年１回決算型）	2,062,999,087円
eMAXIS バランス（４資産均等型）	804,120,763円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	513,472,613円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	278,596,159円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	319,584,243円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	169,995,679円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	67,308,804円
三菱ＵＦＪ 外国債券ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	1,034,245,390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）	103円
三菱ＵＦＪ 外国債券ファンドＶＡ２（適格機関投資家限定）	10,770,661円
MUAM 世界債券オープン（適格機関投資家限定）	1,104,430,219円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,128,596円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,531,499,896円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	1,137,790,024円
MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	41,467,875,411円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	469,398,237円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	384,652円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	102,887円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,274,012,888円
アドバンスト・バランス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	62,425,371円
アドバンスト・バランス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	108,652,517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）	1,031,658,432円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	30,316,366円
MUKAM 外国債券インデックスファンド２（適格機関投資家限定）	2,493,287,490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）	655,362,166円
外国債券インデックスファンドＶ（適格機関投資家限定）	757,085,115円
海外債券インデックスファンドＳ	3,755,208,266円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	1,617,065円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	2,692,654円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	495,786円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	921,040円
三菱ＵＦＪ 外国債券インデックスファンドＶＡ	4,607,218円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	3,552,428円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	7,368,190円

	[2023年12月26日現在]
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	3,383,459円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	8,382,236円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>外国債券インデックスファンド	1,746,007,953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）	197,363,282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）	558,480,567円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	455,065,651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）	186,794,459円
合計	203,202,072,602円
2. 受益権の総数	203,202,072,602口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2023年12月26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（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）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[2023年12月26日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	1,544,789,728	—	1,494,735,819	50,053,909
	カナダドル	5,350,440	—	5,363,855	13,415
	オーストラリアドル	5,799,720	—	5,807,844	8,124
	イギリスポンド	10,825,794	—	10,840,278	14,484
	メキシコペソ	5,098,319	—	5,106,066	7,747
	オフショア元	14,344,502	—	14,302,368	42,134
	ユーロ	76,698,260	—	76,786,987	88,727
	売建				
	アメリカドル	7,111,200	—	7,111,115	85
	ユーロ	9,402,060	—	9,402,114	54
合計		1,679,420,023	—	1,629,456,446	49,963,515

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（１口当たり情報）

	[2023年12月26日現在]
1口当たり純資産額	2.5301円
(1万口当たり純資産額)	(25,301円)

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	[2023年12月26日現在]
資産の部	
流動資産	
預金	468,290,825
コール・ローン	1,272,635,030
国債証券	311,199,769,451
派生商品評価勘定	8,377,517,625
未収入金	102,211,574
未収利息	2,230,449,862
前払費用	179,227,200
流動資産合計	323,830,101,567
資産合計	323,830,101,567
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,614,843
未払金	3,158,391
未払解約金	69,911,648
未払利息	361
流動負債合計	83,685,243
負債合計	83,685,243
純資産の部	
元本等	
元本	283,979,688,252
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	39,766,728,072
元本等合計	323,746,416,324
純資産合計	323,746,416,324
負債純資産合計	323,830,101,567

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。

（貸借対照表に関する注記）

	[2023年12月26日現在]
1. 期首	2023年 6月27日
期首元本額	284,113,964,774円
期中追加設定元本額	24,703,882,049円
期中一部解約元本額	24,838,158,571円
元本の内訳	
e M A X I S 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）	905,907,530円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	7,308,971,051円
ラップ向けインデックス f 先進国債券（為替ヘッジあり）	4,389,465,737円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	143,796,763円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	2,765,361円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	4,475,825円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	3,891,227,596円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	4,223,079,890円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	650,179,167円
三菱ＵＦＪ D C バランス・イノベーション（K A K U S H I N）	4,670,252,923円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	2,068,909,307円
e M A X I S 債券バランス（2資産均等型）	90,028,565円
M U A M ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）	115,144,185,935円
三菱ＵＦＪ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	9,520,204,082円
M U K A M バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	12,039,668,263円
M U K A M バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	3,630,426,677円
M U K A M スマート・クオリティ・セクション（適格機関投資家転売制限付）	395,801,252円
M U K A M 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	10,985,967,964円
M U K A M バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	1,050,122,102円
M U K A M ヘッジ付外国債券インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	18,217,179,226円
M U K A M ヘッジ付外国債券インデックスオープン（適格機関投資家限定）	6,252,508,451円
M U K A M スマート・クオリティ・セクション2（適格機関投資家限定）	246,162,165円
M U K A M 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	60,182,161,264円
M U K A M バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付）	329,562,431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）	774,616円
M U K A M バランスファンド2019-12（適格機関投資家限定）	2,435,092,729円
M U K A M アセットアロケーションファンド2020-07（適格機関投資家限定）	325,643,502円
M U K A M バランスファンド2020-07（適格機関投資家限定）	2,412,645,299円
M U K A M アセットアロケーションファンド2020-09（適格機関投資家限定）	322,196,277円
M U K A M バランスファンド2020-10（適格機関投資家限定）	2,406,347,053円
M U K A M 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）	322,720,012円
M U K A M 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）	321,351,725円
M U K A M バランスファンド2021-03（適格機関投資家限定）	2,129,580,674円
M U K A M 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）	315,633,120円
M U K A M 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）	316,748,113円
M U K A M バランスファンド2021-06（適格機関投資家限定）	2,100,241,630円
M U K A M 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）	312,894,225円
M U K A M 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）	315,490,691円
M U K A M 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）	315,059,067円

	[2023年12月26日現在]
M U K A M 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）	329,350,862円
M U K A M アセットアロケーションファンド２０２２－０３（適格機関投資家限定）	336,722,167円
M U K A M アセットアロケーションファンド２０２２－０５（適格機関投資家限定）	352,830,037円
M U K A M アセットアロケーションファンド２０２２－０７（適格機関投資家限定）	359,565,752円
M U K A M アセットアロケーションファンド２０２２－０９（適格機関投資家限定）	371,026,379円
M U K A M アセットアロケーションファンド２０２２－１１（適格機関投資家限定）	388,518,761円
M U K A M アセットアロケーションファンド２０２３－０１（適格機関投資家限定）	376,017,480円
M U K A M アセットアロケーションファンド２０２３－０３（適格機関投資家限定）	388,520,282円
M U K A M アセットアロケーションファンド２０２３－０５（適格機関投資家限定）	381,708,272円
合計	283,979,688,252円
２．受益権の総数	283,979,688,252口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2023年12月26日現在]
１．貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
２．時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（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）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[2023年12月26日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカドル	147,205,094,517	—	143,005,995,932	4,199,098,585
	カナダドル	6,091,604,455	—	6,063,951,205	27,653,250
	オーストラリアドル	4,396,002,250	—	4,382,347,365	13,654,885
	イギリスポンド	16,029,616,272	—	15,566,939,270	462,677,002
	シンガポールドル	1,320,403,010	—	1,289,094,516	31,308,494
	マレーシアリンギット	1,634,527,653	—	1,599,464,636	35,063,017
	ニュージーランドドル	692,952,052	—	689,153,192	3,798,860

スウェーデンクローネ	634,389,795	—	637,650,390	3,260,595
ノルウェークローネ	537,866,516	—	545,220,764	7,354,248
デンマーククローネ	892,318,320	—	868,727,582	23,590,738
メキシコペソ	2,775,327,581	—	2,750,275,268	25,052,313
イスラエルシェケル	946,415,599	—	937,410,242	9,005,357
ポーランドズロチ	1,665,970,464	—	1,626,446,432	39,524,032
中国元	24,362,824,014	—	23,604,656,165	758,167,849
ユーロ	103,472,479,928	—	100,723,556,685	2,748,923,243
合計	312,657,792,426	—	304,290,889,644	8,366,902,782

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（１口当たり情報）

	[2023年12月26日現在]
1口当たり純資産額	1.1400円
(1万口当たり純資産額)	(11,400円)

新マネー・マーケット・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[2023年12月26日現在]	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	999,124,779
現先取引勘定	1,400,154,000
流動資産合計	2,399,278,779
資産合計	2,399,278,779
負債の部	
流動負債	
未払利息	283
流動負債合計	283
負債合計	283
純資産の部	
元本等	
元本	2,425,181,195
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	25,902,699
元本等合計	2,399,278,496
純資産合計	2,399,278,496
負債純資産合計	2,399,278,779

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

	[2023年12月26日現在]
1. 期首	2023年 6月27日
期首元本額	27,137,884円
期中追加設定元本額	9,843,867,955円
期中一部解約元本額	7,445,824,644円
元本の内訳	
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	2,222,650,544円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	127,333,567円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	58,701,503円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	4,846,766円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	11,143,866円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	504,949円
合計	2,425,181,195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。	25,902,699円
3. 受益権の総数	2,425,181,195口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2023年12月26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、該当事項はありません。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[2023年12月26日現在]
1口当たり純資産額	0.9893円
(1万口当たり純資産額)	(9,893円)

2【ファンドの現況】

【ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）】

【純資産額計算書】

2023年12月29日現在

（単位：円）

資産総額	90,686,461,838
負債総額	354,175,560

純資産総額（ - ）	90,332,286,278
発行済口数	92,460,819,411口
1口当たり純資産価額（ / ）	0.9770
（10,000口当たり）	（9,770）

（参考）

ＴＯＰＩＸマザーファンド

純資産額計算書

2023年12月29日現在

（単位：円）

資産総額	1,195,389,836,921
負債総額	18,555,669,364
純資産総額（ - ）	1,176,834,167,557
発行済口数	409,734,488,070口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.8722
（10,000口当たり）	（28,722）

外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2023年12月29日現在

（単位：円）

資産総額	3,624,877,417,758
負債総額	899,930,009
純資産総額（ - ）	3,623,977,487,749
発行済口数	612,393,536,675口
1口当たり純資産価額（ / ）	5.9177
（10,000口当たり）	（59,177）

国内債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2023年12月29日現在

（単位：円）

資産総額	194,322,391,997
負債総額	2,543,450,877
純資産総額（ - ）	191,778,941,120
発行済口数	205,740,610,890口
1口当たり純資産価額（ / ）	0.9321
（10,000口当たり）	（9,321）

日本短期債券マザーファンド

純資産額計算書

2023年12月29日現在

（単位：円）

資産総額	21,739,273,824
負債総額	1,501,957,835
純資産総額（ - ）	20,237,315,989
発行済口数	18,023,114,509口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.1229
（10,000口当たり）	（11,229）

外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2023年12月29日現在

（単位：円）

資産総額	518,155,375,112
負債総額	1,557,267,813
純資産総額（ - ）	516,598,107,299
発行済口数	203,844,088,908口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.5343
（10,000口当たり）	（25,343）

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2023年12月29日現在

（単位：円）

資産総額	325,630,693,148
負債総額	775,284,224
純資産総額（ - ）	324,855,408,924
発行済口数	284,420,401,034口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.1422
（10,000口当たり）	（11,422）

新マネー・マーケット・マザーファンド

純資産額計算書

2023年12月29日現在

（単位：円）

資産総額	2,399,263,229
負債総額	1,258
純資産総額（ - ）	2,399,261,971
発行済口数	2,425,181,195口
1口当たり純資産価額（ / ）	0.9893
（10,000口当たり）	（9,893）

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

< 更新後 >

（１）資本金の額等

2023年12月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近５年間に於ける資本金の額の増減はありません。

（２）委託会社の機構

・ 会社の意思決定機構

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

・ 投資運用の意思決定機構

投資環境見通しの策定

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

運用戦略の決定

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

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

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

運用部門による自律的な運用管理

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、運用部門内の管理担当部署は逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また、運用戦略・管理委員会を通じて運用状況のモニタリングを行い、運用部門内での自律的牽制により運用改善を図ります。

管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署は、（a）運用に関するパフォーマンス測定・分析、意図した運用成果が得られていない場合にはその原因の分析のほか、（b）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、（a）についてはファンド管理委員会における審議を経て運用担当部・商品開発担当部にフィードバックされ、（b）についてはリスク管理委員会を通じて運用担当部にフィードバックされ、必要に応じて部署間連携の上で是正・改善の検討が行われます。

ファンドに係る法人等の管理

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

運用・管理に関する監督

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

告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

< 更新後 >

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

2023年12月29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	847	28,140,566
追加型公社債投資信託	16	1,558,854
単位型株式投資信託	98	441,378
単位型公社債投資信託	49	96,721
合 計	1,010	30,237,519

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

3【委託会社等の経理状況】

< 更新後 >

（ 1 ）財務諸表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アセットマネジメント株式会社（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38期事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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39期事業年度に係る中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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る監査を受けております。

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37期 (2022年3月31日現在)		第38期 (2023年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	2	51,593,362	2	51,733,041
有価証券		293,326		1,579,691
前払費用		645,109		770,747
未収入金		61,092		81,854
未収委託者報酬		15,750,264		16,753,855
未収収益	2	783,790	2	688,142
金銭の信託		8,401,300		10,400,000
その他		295,584		745,576
流動資産合計		77,823,830		82,752,908
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	391,042	1	181,551
器具備品	1	1,079,023	1	730,357
土地		628,433		628,433
建設仮勘定		-		1,111,177
有形固定資産合計		2,098,499		2,651,520
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		4,381,293		4,183,644
ソフトウェア仮勘定		1,581,652		1,907,739
無形固定資産合計		5,978,768		6,107,206
投資その他の資産				
投資有価証券		16,803,642		12,022,365
関係会社株式		159,536		159,536
投資不動産	1	810,684	1	807,066
長期差入保証金		524,244		689,492
前払年金費用		189,708		118,832
繰延税金資産		982,406		1,675,132
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		19,491,852		15,494,056
固定資産合計		27,569,120		24,252,782
資産合計		105,392,950		107,005,691

（単位：千円）

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	565,222	507,559
未払金		

未払収益分配金	197,334	114,094
未払償還金	7,418	7,418
未払手数料	2 6,423,139	2 6,139,595
その他未払金	2 4,565,457	2 955,697
未払費用	2 4,328,968	2 5,778,896
未払消費税等	1,112,923	439,657
未払法人税等	769,692	2,375,281
賞与引当金	942,287	849,840
役員賞与引当金	149,028	154,872
その他	5,517	5,517
流動負債合計	19,066,990	17,328,431
固定負債		
長期未払金	10,800	-
退職給付引当金	1,246,300	1,333,882
役員退職慰労引当金	117,938	75,667
時効後支払損引当金	250,214	254,296
固定負債合計	1,625,252	1,663,846
負債合計	20,692,243	18,992,277
(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	29,000,498	33,267,700
利益剰余金合計	36,341,088	40,608,289
株主資本合計	83,073,932	87,341,133

(単位：千円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023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	1,626,775	672,279
評価・換算差額等合計	1,626,775	672,279
純資産合計	84,700,707	88,013,413
負債純資産合計	105,392,950	107,005,691

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		79,977,953		84,121,445
投資顧問料		2,711,169		2,750,601
その他営業収益		13,459		10,412
営業収益合計		82,702,582		86,882,459
営業費用				
支払手数料	2	31,644,834	2	31,461,274
広告宣伝費		720,785		798,894
公告費		500		375
調査費				
調査費		2,430,158		2,849,042
委託調査費		14,557,009		19,236,505
事務委託費		1,450,062		1,751,807
営業雑経費				
通信費		138,868		113,480
印刷費		379,428		367,379
協会費		49,590		58,128
諸会費		17,729		18,447
事務機器関連費		2,172,978		2,238,382
その他営業雑経費		649		-
営業費用合計		53,562,596		58,893,717
一般管理費				
給料				
役員報酬		414,260		416,461
給料・手当		6,496,233		6,565,766
賞与引当金繰入		942,287		849,840
役員賞与引当金繰入		149,028		154,872
福利厚生費		1,282,310		1,279,885
交際費		4,874		8,942
旅費交通費		21,698		75,274
租税公課		430,233		403,955
不動産賃借料		724,961		719,707
退職給付費用		494,615		388,176
固定資産減価償却費		2,249,287		2,418,341
諸経費		379,054		444,313
一般管理費合計		13,588,846		13,725,534
営業利益		15,551,139		14,263,207

(単位：千円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		243,133		47,353
受取利息	2	7,408	2	10,279

投資有価証券償還益		1,089,101		609,102
収益分配金等時効完成分		137,485		94,351
受取賃貸料	2	65,808	2	65,808
その他		36,211		36,894
営業外収益合計		1,579,148		863,788
営業外費用				
投資有価証券償還損		3,074		32,995
時効後支払損引当金繰入		16,548		31,951
事務過誤費		76,076		2,680
賃貸関連費用		15,780		14,262
その他		7,585		32,394
営業外費用合計		119,066		114,284
経常利益		17,011,221		15,012,711
特別利益				
投資有価証券売却益		605,706		387,113
特別利益合計		605,706		387,113
特別損失				
投資有価証券売却損		28,188		15,828
投資有価証券評価損		36,558		104,554
固定資産除却損	1	13,094	1	32,791
減損損失		-	3	315,350
特別損失合計		77,840		468,524
税引前当期純利益		17,539,087		14,931,300
法人税、住民税及び事業税	2	5,366,608	2	4,860,444
法人税等調整額		22,446		271,471
法人税等合計		5,389,054		4,588,973
当期純利益		12,150,032		10,342,327

(3) 【株主資本等変動計算書】

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
会計方針の変更による累積的影響額				
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
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)				
当期変動額合計	—	—	—	—
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712

	利益剰余金				株主資本合計
	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	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	342,589	6,998,000	27,426,976	34,767,566	81,500,410
当期変動額					
剰余金の配当			10,576,511	10,576,511	10,576,511
当期純利益			12,150,032	12,150,032	12,150,032
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)					
当期変動額合計	—	—	1,573,521	1,573,521	1,573,521
当期末残高	342,589	6,998,000	29,000,498	36,341,088	83,073,932

	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
当期変動額			
剰余金の配当			10,576,511
当期純利益			12,150,032
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	674,831	674,831	674,831
当期変動額合計	674,831	674,831	898,690
当期末残高	1,626,775	1,626,775	84,700,707

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）				
当期変動額合計	—	—	—	—

当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
-------	-----------	-----------	------------	------------

	利益剰余金				株主資本合計
	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	342,589	6,998,000	29,000,498	36,341,088	83,073,932
当期変動額					
剰余金の配当			6,075,125	6,075,125	6,075,125
当期純利益			10,342,327	10,342,327	10,342,327
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)					
当期変動額合計	—	—	4,267,201	4,267,201	4,267,201
当期末残高	342,589	6,998,000	33,267,700	40,608,289	87,341,133

	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	1,626,775	1,626,775	84,700,707
当期変動額			
剰余金の配当			6,075,125
当期純利益			10,342,327
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	954,495	954,495	954,495
当期変動額合計	954,495	954,495	3,312,705
当期末残高	672,279	672,279	88,013,413

[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

市場価格のない株式等以外のもの

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、1998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2016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	5年～47年

(2)無形固定資産

定額法を採用しております。

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

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. 引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

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

(2)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3)役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5)役員退職慰労引当金

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

(6)時効後支払損引当金

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

6. 収益及び費用の計上基準

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。委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を投資信託によって主に年2回受領しております。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。投資顧問料は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を主に年4回受領しております。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。

7. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

（会計方針の変更）

時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用

「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 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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、時価算定会計基準適用指針の適用による、財務諸表への影響はありません。

（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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
建物	805,250千円	1,006,606千円
器具備品	2,054,366千円	1,985,072千円
投資不動産	157,995千円	163,978千円

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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
預金	43,782,913千円	40,165,058千円
未収収益	13,741千円	15,046千円
未払手数料	836,105千円	790,279千円
その他未払金	3,887,520千円	77,007千円
未払費用	337,847千円	277,358千円

（損益計算書関係）

1. 固定資産除却損の内訳

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
建物	2,599千円	1,047千円
器具備品	10,495千円	29,762千円
ソフトウェア	-	1,981千円
計	13,094千円	32,791千円

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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
支払手数料	5,153,589千円	4,893,312千円
受取利息	7,377千円	10,236千円
受取賃貸料	65,808千円	68,168千円
法人税、住民税及び事業税	4,062,765千円	3,947,200千円

3. 減損損失

当社は、以下のとおり減損損失を計上しました。

場所	用途	種類	金額
東京都千代田区（本社）	ホームページ	ソフトウェア	315,350千円

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグループिंगとしております。

翌期において、ホームページのリニューアルを予定しており、現行のホームページについて将来の利用終了が見込まれるため帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、回収可能価額として使用価値を用いておりますが、割引率については使用見込期間が短いため考慮していません。

(株主資本等変動計算書関係)

第37期（自 2021年4月1日 至 2022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

2021年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	10,576,511千円
1株当たり配当額	49,988円
基準日	2021年3月31日
効力発生日	2021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

2022年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	6,075,125千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	28,713円
基準日	2022年3月31日
効力発生日	2022年6月29日

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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

2022年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	6,075,125千円
1株当たり配当額	28,713円
基準日	2022年3月31日
効力発生日	2022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

2023年6月28日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

配当金の総額	5,171,039千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	24,440円
基準日	2023年3月31日
効力発生日	2023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37期
(2022年3月31日現在)

第38期
(2023年3月31日現在)

1年内	709,808千円	962,809千円
1年超	414,054千円	1,532,728千円
合計	1,123,863千円	2,495,537千円

（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。

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、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）。

第37期(2022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) 有価証券	293,326	293,326	-
(2) 金銭の信託	8,401,300	8,401,300	-
(3) 投資有価証券	16,772,282	16,772,282	-
資産計	25,466,909	25,466,909	-

(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（前事業年度の貸借対照表計上額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、関連会社株式（前事業年度の貸借対照表計上額159,536千円）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。

(注4) 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37期(2022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	51,593,362	-	-	-
金銭の信託	8,401,300	-	-	-
未収委託者報酬	15,750,264	-	-	-
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	293,326	6,911,464	3,695,585	-
合計	76,038,253	6,911,464	3,695,585	-

第38期(2023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) 有価証券	1,579,691	1,579,691	-
(2) 金銭の信託	10,400,000	10,400,000	-
(3) 投資有価証券	12,022,365	12,022,365	-
資産計	24,002,056	24,002,056	-

(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

関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額159,536千円）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。

(注4) 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38期(2023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	51,733,041	-	-	-
金銭の信託	10,400,000	-	-	-
未収委託者報酬	16,753,855	-	-	-
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	1,579,691	4,859,714	1,433,213	-
合計	80,466,587	4,859,714	1,433,213	-

3. 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。

時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

第37期(2022年3月31日現在)

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	-	8,401,300	-	8,401,300
資産計	-	8,401,300	-	8,401,300

財務諸表等規則附則（2021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（貸借対照表計上額 有価証券 293,326千円、投資有価証券16,772,282千円）は、表には含めておりません。

(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。

第38期(2023年3月31日現在)

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券	-	1,579,691	-	1,579,691
金銭の信託	-	10,400,000	-	10,400,000

投資有価証券	1,794,704	10,227,661	-	12,022,365
資産計	1,794,704	22,207,352	-	24,002,056

（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

有価証券及び投資有価証券

ETF（上場投資信託）は相場価格を用いて評価しております。ETFは活発な市場で取引されているため、レベル1の時価に分類しております。

ETF（上場投資信託）以外の投資信託は基準価額を用いて評価しております。基準価額は観察可能なインプットを用いて算出しているため、レベル2の時価に分類しております。

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）

1. 子会社株式及び関連会社株式

第37期（2022年3月31日現在）及び第38期（2023年3月31日現在）

関連会社株式（貸借対照表計上額は159,536千円）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

第37期(2022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	19,193,250	16,560,340	2,632,910
	小計	19,193,250	16,560,340	2,632,910
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	6,273,658	6,561,836	288,177
	小計	6,273,658	6,561,836	288,177
合計		25,466,909	23,122,176	2,344,732

（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8,401,300千円、取得原価は8,400,000千円）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、市場価格がないため、含めておりません。

第38期(2023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	8,983,713	7,558,314	1,425,399
	小計	8,983,713	7,558,314	1,425,399
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	15,018,343	15,474,760	456,417
	小計	15,018,343	15,474,760	456,417
合計		24,002,056	23,033,074	968,982

（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10,400,000千円、取得原価は10,400,000千円）を含めております。

3. 売却したその他有価証券

第37期（自 2021年4月1日 至 2022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	4,164,921	605,706	28,188
合計	4,164,921	605,706	28,188

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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	17,240	-	14,120
債券	-	-	-
その他	1,551,405	387,113	1,708
合計	1,568,645	387,113	15,828

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。

当事業年度において、有価証券について104,554千円（その他有価証券のその他104,554千円）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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,729,235 千円	3,723,521 千円
勤務費用	198,457	196,190
利息費用	21,549	25,925
数理計算上の差異の発生額	46,069	186,130
退職給付の支払額	179,650	176,727
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	3,723,521	3,582,778

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
年金資産の期首残高	2,649,846 千円	2,583,927 千円
期待運用収益	47,588	46,453
数理計算上の差異の発生額	1,824	103,934
事業主からの拠出額	-	-
退職給付の支払額	115,331	100,694
年金資産の期末残高	2,583,927	2,425,752

(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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
積立型制度の 退職給付債務 年金資産	2,675,015 千円	2,468,195 千円
	2,583,927	2,425,752
	91,087	42,442
非積立型制度の退職給付 債務	1,048,506	1,114,583
未積立退職給付債務	1,139,593	1,157,025
未認識数理計算上の差異	205,679	281,343
未認識過去勤務費用	288,681	223,319
貸借対照表に計上された 負債と資産の純額	1,056,591	1,215,049
退職給付引当金	1,246,300	1,333,882
前払年金費用	189,708	118,832
貸借対照表に計上された 負債と資産の純額	1,056,591	1,215,049

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	198,457 千円	196,190 千円
利息費用	21,549	25,925
期待運用収益	47,588	46,453
数理計算上の差異の 費用処理額	3,547	6,532
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	109,013	1,600
確定給付制度に係る 退職給付費用	343,245	236,091

（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及び退職金です。

(5)年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
債券	62.0 %	63.6 %
株式	36.3	34.2
その他	1.7	2.2
合計	100	100

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
割引率	0.078～0.72%	0.066～1.13%
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151,370千円、当事業年度152,084千円であります。

（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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	410,082千円	499,742千円
投資有価証券評価損	65,490	47,876
未払事業税	165,702	169,997
賞与引当金	288,528	260,221
役員賞与引当金	25,799	29,828
役員退職慰労引当金	36,112	23,169
退職給付引当金	381,617	408,434
減価償却超過額	145,316	227,100
差入保証金	-	52,869
長期差入保証金	52,869	-
時効後支払損引当金	76,615	77,865
連結納税適用による時価評価	35,311	35,311
その他	76,257	177,003
繰延税金資産 小計	1,759,702	2,009,420
評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	1,759,702	2,009,420
繰延税金負債		
前払年金費用	58,088	36,386
連結納税適用による時価評価	1,149	1,098
その他有価証券評価差額金	717,957	296,702
その他	101	101
繰延税金負債 合計	777,296	334,288
繰延税金資産の純額	982,406	1,675,132

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37期（2022年3月31日現在）及び第38期（2023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。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（収益認識関係）

1. 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。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

収益を理解するための基礎となる情報は、「（重要な会計方針）の6.収益および費用の計上基準」に

記載のとおりであります。

- 3.顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

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（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）及び第38期（自 2022年4月1日 至 2023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37期（自2021年4月1日 至 2022年3月31日）及び第38期（自 2022年4月1日 至 2023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37期（自 2021年4月1日 至 2022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5)	科目	期末残高 (注5)
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)	4,062,765 千円	その他未払金	3,887,520 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)	5,153,589 千円	未払手数料	836,105 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 (注3)	499,388 千円	未払費用	272,264 千円

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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5)	科目	期末残高 (注5)
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%	連結納税等	連結納税等に 伴う支払 (注4)	3,947,200 千円	その他未払金	77,007 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 投資の助言 役員の兼任	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2) 投資助言料 (注3)	4,893,312 千円 463,416 千円	未払手数料 未払費用	790,279 千円 253,093 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. 連結納税制度及びグループ通算制度に基づく法人税の支払予定額であります。

5. 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37期（自 2021年4月1日 至 2022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2)	科目	期末残高 (注2)
同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ 銀行	東京都 千代田 区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注1)	4,097,951 千円	未払手数料	838,058 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)	7,025,984 千円	未払手数料	1,319,958 千円

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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2)	科目	期末残高 (注2)
----	--------	-----	-----	-------	------------------------	---------------	-------	--------------	----	--------------

同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注1）	4,052,979 千円	未払手数料	868,785 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）	6,661,991 千円	未払手数料	1,218,051 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．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37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
１株当たり純資産額	400,322.84円	415,979.76円
１株当たり当期純利益金額	57,424.97円	48,881.17円

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

２．１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
当期純利益金額（千円）	12,150,032	10,342,327
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）	12,150,032	10,342,327
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39期中間会計期間

（2023年9月30日現在）

（資産の部）

流動資産

現金及び預金		49,727,641
有価証券		1,621,227
前払費用		710,443
未収入金		93,528
未収委託者報酬		19,282,859
未収収益		770,875
金銭の信託		10,401,000
その他		740,886
流動資産合計		83,348,451
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	2,546,133
器具備品	1	1,676,631
土地		628,433
建設仮勘定		10,560
有形固定資産合計		4,861,758
無形固定資産		
電話加入権		15,822
ソフトウェア		4,917,655
ソフトウェア仮勘定		1,357,259
無形固定資産合計		6,290,737
投資その他の資産		
投資有価証券		14,016,994
関係会社株式		159,536
投資不動産	1	1,580,210
長期差入保証金		689,627
前払年金費用		83,203
繰延税金資産		1,274,071
その他		45,230
貸倒引当金		23,600
投資その他の資産合計		17,825,273
固定資産合計		28,977,769
資産合計		112,326,220

(単位：千円)

第39期中間会計期間

(2023年9月30日現在)

(負債の部)		
流動負債		
預り金		492,861
未払金		
未払収益分配金		105,556
未払償還金		44,768
未払手数料		6,929,093
その他未払金		3,313,588
未払費用		6,935,916
未払消費税等	2	319,737
未払法人税等		2,205,065
賞与引当金		899,167
役員賞与引当金		78,660
その他		5,517
流動負債合計		21,329,934
固定負債		
退職給付引当金		1,375,952

役員退職慰労引当金	32,510
時効後支払損引当金	252,955
資産除去債務	704,072
固定負債合計	2,365,490
負債合計	23,695,424

(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	33,502,194
利益剰余金合計	40,842,784
株主資本合計	87,575,628

(単位：千円)

第39期中間会計期間

(2023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	1,055,167
評価・換算差額等合計	1,055,167
純資産合計	88,630,795
負債純資産合計	112,326,220

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第39期中間会計期間

(自 2023年4月1日
至 2023年9月30日)

営業収益	
委託者報酬	47,550,495
投資顧問料	1,407,644
その他営業収益	10,158
営業収益合計	48,968,298
営業費用	
支払手数料	16,737,084
広告宣伝費	208,241
公告費	892
調査費	
調査費	1,594,100
委託調査費	12,907,263
事務委託費	947,553
営業雑経費	
通信費	53,048
印刷費	194,402
協会費	33,149
諸会費	9,640
事務機器関連費	1,212,110
その他営業雑経費	5,384

営業費用合計		33,902,872
一般管理費		
給料		
役員報酬		190,163
給料・手当		2,957,056
賞与引当金繰入		899,167
役員賞与引当金繰入		78,660
福利厚生費		645,394
交際費		4,144
旅費交通費		46,547
租税公課		204,887
不動産賃借料		390,491
退職給付費用		188,933
固定資産減価償却費	1	1,169,259
諸経費		275,931
一般管理費合計		7,050,636
営業利益		8,014,788

(単位：千円)

第39期中間会計期間

（自 2023年4月1日

至 2023年9月30日）

営業外収益		
受取配当金		27,966
受取利息		6,353
投資有価証券償還益		19,971
収益分配金等時効完成分		15,896
受取賃貸料		36,751
その他		20,823
営業外収益合計		127,762
営業外費用		
投資有価証券償却損		53,716
時効後支払損引当金繰入		1,347
事務過誤費		10,736
賃貸関連費用	1	16,188
その他		3,902
営業外費用合計		85,890
経常利益		8,056,659
特別利益		
投資有価証券売却益		132,206
固定資産売却益		1,021
特別利益合計		133,228
特別損失		
投資有価証券売却損		30,309
投資有価証券評価損		28,130
固定資産除却損		20,162
固定資産売却損		65,427
その他特別損失		289,389
特別損失合計		433,419
税引前中間純利益		7,756,468
法人税、住民税及び事業税		2,118,856
法人税等調整額		232,077
法人税等合計		2,350,934
中間純利益		5,405,533

(3)中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

(単位：千円)

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
当中間期変動額				
剰余金の配当				
中間純利益				
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	—	—	—	—
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712

	利益剰余金				株主資本合計
	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	342,589	6,998,000	33,267,700	40,608,289	87,341,133
当中間期変動額					
剰余金の配当			5,171,039	5,171,039	5,171,039
中間純利益			5,405,533	5,405,533	5,405,533
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	—	—	234,494	234,494	234,494
当中間期末残高	342,589	6,998,000	33,502,194	40,842,784	87,575,628

	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	672,279	672,279	88,013,413
当中間期変動額			
剰余金の配当			5,171,039
中間純利益			5,405,533
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	382,887	382,887	382,887
当中間期変動額合計	382,887	382,887	617,382
当中間期末残高	1,055,167	1,055,167	88,630,795

[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、1998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2016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～50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。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく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。委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を投資信託によって主に年2回受領しております。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。投資顧問料は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を主に年4回受領しております。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

グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

1 減価償却累計額

第39期中間会計期間 (2023年9月30日現在)	
建物	407,329千円
器具備品	1,336,738千円
投資不動産	170,993千円

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39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
有形固定資産	225,710千円
無形固定資産	943,548千円
投資不動産	7,015千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第39期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023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

2023年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	5,171,039千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	24,440円
基準日	2023年3月31日
効力発生日	2023年6月29日

(リース取引関係)

第39期中間会計期間(2023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	740,363千円
1年超	1,192,121千円
合 計	1,932,485千円

（金融商品関係）

第39期中間会計期間(2023年9月30日現在)

1. 金融商品の時価等に関する事項

2023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	1,621,227	1,621,227	-
(2) 金銭の信託	10,401,000	10,401,000	-
(3) 投資有価証券	14,016,994	14,016,994	-
資産計	26,039,221	26,039,221	

（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

関連会社株式（中間貸借対照表計上額 159,536千円）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。

時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券	-	1,621,227	-	1,621,227
金銭の信託	-	10,401,000	-	10,401,000
投資有価証券	2,257,164	11,759,829	-	14,016,994
資産計	2,257,164	23,782,057	-	26,039,221

（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

有価証券及び投資有価証券

ETF（上場投資信託）は相場価格を用いて評価しております。ETFは活発な市場で取引されているため、レベル1の時価に分類しております。

ETF（上場投資信託）以外の投資信託は基準価額を用いて評価しております。基準価額は観察可能なインプットを用いて算出しているため、レベル2の時価に分類しております。

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39期中間会計期間（2023年9月30日現在）

1. 子会社及び関連会社株式

関連会社株式（中間貸借対照表計上額 159,536千円）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	15,250,611	13,190,791	2,059,819
	小 計	15,250,611	13,190,791	2,059,819
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	10,788,610	11,327,577	538,966
	小 計	10,788,610	11,327,577	538,966
合 計		26,039,221	24,518,369	1,520,852

（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10,401,000千円、取得価額10,400,000千円）を含めております。

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28,130千円（その他有価証券のその他28,130千円）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。

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの

当該資産除去債務の総額の増減

第39期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）	
期首残高	-
有形固定資産の取得に伴う増加	704,072千円
時の経過による調整額	-
中間期末残高	704,072千円

（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39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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39期中間会計期間 (2023年9月30日現在)
1株当たり純資産額	418,897.70円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	88,630,795
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	88,630,795
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39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
1株当たり中間純利益金額	25,548.29円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	5,405,533
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)	5,405,533
普通株式の期中平均株式数(株)	211,581

(注)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、記載していません。

(重要な後発事象)

共通支配下の取引等

当社は2023年7月31日開催の取締役会において、三菱ＵＦＪ不動産投資顧問株式会社(旧商号：ＭＵ投資顧問株式会社)と吸収分割契約を締結することを決議し、同日、吸収分割の効力発生日を2023年10月1日とする吸収分割契約を締結いたしました。本吸収分割契約に基づき、当社と三菱ＵＦＪ不動産投資顧問株式会社は、2023年10月1日付で吸収分割を実施いたしました。

なお、2023年10月1日付で当社は「三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社」へ商号変更しました。

(1) 取引の概要

被取得企業の名称及びその事業の内容

被取得企業の名称 三菱ＵＦＪ不動産投資顧問株式会社

事業の内容 投資顧問業、私募投資信託の設定・運用等

企業結合日

2023年10月1日

企業結合の法的形式

当社と兄弟会社である三菱ＵＦＪ不動産投資顧問株式会社を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする無対価吸収分割

結合後企業の名称

分割会社：三菱ＵＦＪ不動産投資顧問株式会社

承継会社：三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

企業結合を行う主な理由

法人投資家の運用ニーズが拡大しており、両社で取り組みを強化している法人投資家ビジネスにかかる運用・営業等の関連機能を三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社に統合することで、リソースやノウハウの集約を通じた運用機能等の強化を図ってまいります。

(2) 実施する会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準（企業会計基準第21号 2019年1月16日）」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針（企業会計基準適用指針第10号 2019年1月16日）」に基づき、共通支配下の取引として処理する予定です。

5【その他】

<訂正前>

定款の変更等

定款について2023年10月1日付で以下の変更を行います。

・商号の変更（三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社に変更）

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

<訂正後>

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

委託会社は2023年10月1日にエム・ユー投資顧問株式会社の有価証券運用事業を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社へ統合し、商号を三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社に変更しました。

上記以外、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】

<更新後>

(1) 受託会社

名称：三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

（再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）

資本金の額：324,279百万円（2023年9月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (2023年9月末現在)	事業の内容
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。

3【資本関係】

<訂正前>

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2023年6月末現在）

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

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

<訂正後>

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2023年12月末現在）

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

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

独立監査人の中間監査報告書

2024年2月28日

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）の2023年6月27日から2023年12月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）の2023年12月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年6月27日から2023年12月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

三菱ＵＦＪアセットマネジメント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）１．上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

２．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2023年6月9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

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 伊藤 鉄也

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2022年4月1日から2023年3月31日までの第38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2023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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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）１． 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
２． XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年12月1日

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

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

山田 信之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

田嶋 大士

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アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023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アセットマネジメント株式会社の2023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（2023年4月1日から2023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な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するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用し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）１． 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
２． XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。