

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年12月6日提出
【計算期間】	第22特定期間(自 2024年3月9日至 2024年9月9日)
【ファンド名】	三菱UFJ／ピムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型> (毎月決算型) 三菱UFJ／ピムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)
【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
【連絡場所】	東京都港区東新橋一丁目9番1号
【電話番号】	03-4223-3037
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の成長と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、各ファンドについて、1兆円です。

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

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

商品分類表

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

属性区分表

三菱UFJ／ピムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型>（毎月決算型）

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 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回 年6回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり (限定ヘッジ)	日経225	ブル・ベア型
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ()	年12回 (毎月)	日本 北米 欧州 アジア オセアニア	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (債券 一般))	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング			その他 ()	ロング・ ショート型／ 絶対収益 追求型
資産複合 ()						その他 ()

三菱UFJ／ピムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし>（毎月決算型）

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 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 (債券 一般)) 資産複合 ()	年1回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり ()	日経225 TOPIX	ブル・ベア型 条件付運用型
	年2回					
	年4回	日本 北米 欧州	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	その他 ()	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型
	年6回 (隔月)					
	年12回 (毎月)	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				その他 ()
	日々 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の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。

補足分類	M R F（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「M R F及びMMFの運営に関する規則」に規定するM R Fをいいます。
	E T F	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。
	インデックス型 特殊型	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。 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（B B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（B B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。

投資対象地域	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第２条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対 象 イ ン デックス	日経２２５	信託約款において、日経２２５に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	ＴＯＰＩＸ	信託約款において、ＴＯＰＩＸに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型／絶対収益追求型	信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。

その他	信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。
-----	---

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

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

世界(新興国を含みます。)の米ドル建てを中心とする投資適格債券等を実質的な主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。

ファンドの特色

投資対象

世界(新興国を含みます。以下同じ。)の米ドル建てを中心とする投資適格債券等が実質的な主要投資対象です。

- 主として円建外国投資信託への投資を通じて、世界の米ドル建てを中心とする投資適格債券等を実質的な投資を行います。また、証券投資信託であるマネー・マーケット・マザーファンド(わが国の短期公社債等に投資)への投資も行います。
- ・ファンドの主な投資対象は以下のとおりです。

国債

政府機関債

社債

モーゲージ証券

資産担保証券

ただし、BB格相当以下の債券、米国以外の債券、エマージング債券、バンクローン、転換社債などにも投資を行う場合があります。

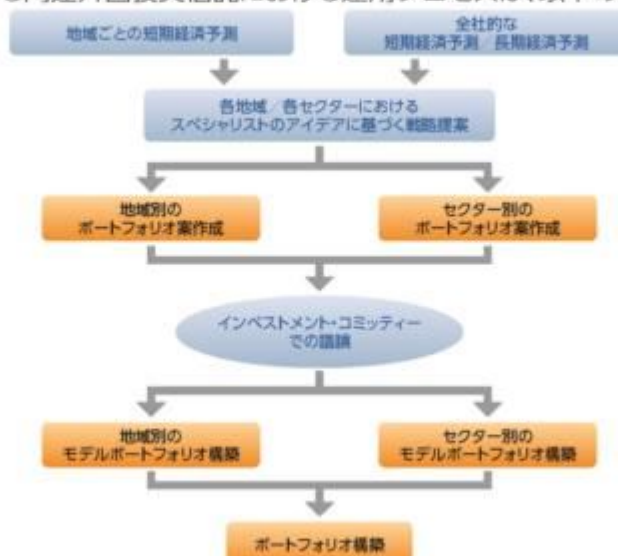
☐ モーゲージ証券とは住宅ローン等の債権を担保として、資産担保証券はカード・自動車ローン等のローン債権を担保として発行された証券です。

❗ 上記の債券が組入れられない場合や、上記以外の債券が組入れられる場合があります。

運用方法 運用プロセス

投資対象とする円建外国投資信託への投資は高位を維持することを基本とします。

- 投資対象とする円建外国投資信託において、世界の米ドル建てを中心とする投資適格債券等への分散投資を行うことにより、最大限のトータル・リターン(公社債等の利子および値上がりによる収益)を追求します。
- 投資対象とする円建外国投資信託における運用プロセスは、以下の通りです。



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

📄 「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/investment_policy/fm.html)

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

「米ドルヘッジ型」と「為替ヘッジなし」の2つがあります。

- 「三菱UFJ」/ピムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型> (毎月決算型) は、原則として投資する外国投資信託において、当該外国投資信託の純資産総額を米ドル換算した額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行い、為替変動リスクの低減を図ります。
- ◆ 実質的な通貨配分にかかわらず、米ドル売り円買いの為替取引を行うため、実質的な組入外貨のうち、米ドル以外の通貨については、米ドルに対する当該通貨の為替変動の影響を受けます。
- ◆ 為替取引を行うにあたっては、日米間の金利差に基づくコストがかかる場合があります。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上の為替取引によるコストとなる場合があります。
- 「三菱UFJ」/ピムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型) は、原則として為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

■ファンドの仕組み

ファンド・オブ・ファンズ方式により運用を行います。



- ① スイッチングの取扱いについては、スイッチングの取扱いを行わない販売会社もあるため、詳しくは、販売会社にご確認下さい。
- ② スイッチングの際の購入時手数料は、販売会社が定めるものとします。また、換金するファンドに対して税金がかかります。

分配方針**毎月の決算時に分配を行います。**

- 毎月の決算時(8日(休業日の場合は翌営業日))に分配を行います。
- 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。
- 原則として、配当等収益や分配対象額の水準等を考慮し、安定した分配を継続することをめざします。
- 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。また、基準価額水準、運用状況等によっては安定した分配とならないことがあります。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。

収益分配金に関する留意事項

- ◆分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



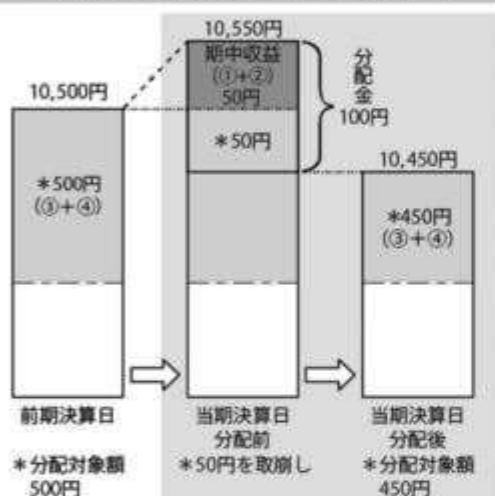
- ◆分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。

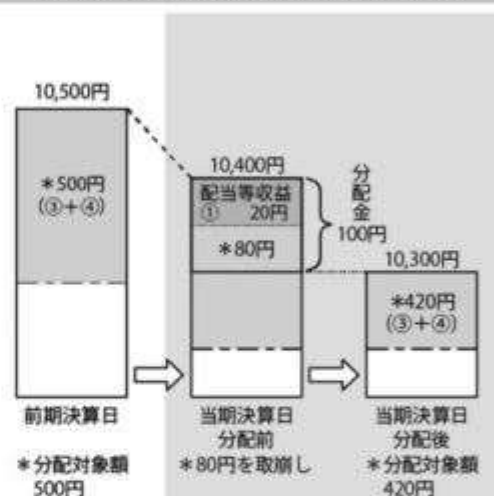
分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算日から基準価額が上昇した場合



前期決算日から基準価額が下落した場合



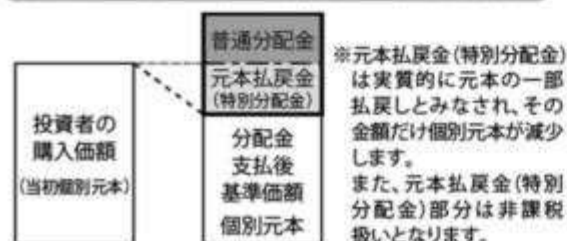
※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

分配準備積立金：当期の①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益のうち、当期分配金として支払わなかった残りの金額をいいます。信託財産に留保され、次期以降の分配金の支払いに充当できる分配対象額となります。

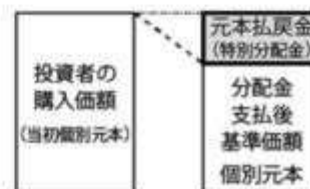
収益調整金：追加型投資信託で追加設定が行われることによって、既存の受益者への収益分配可能額が薄まらないようにするために設けられた勘定です。

- ◆投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には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率が小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金：個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金(特別分配金)：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

(注) 普通分配金に対する課税については、「4 手数料等及び税金 (5) 課税上の取扱い」をご参照ください。

■主な投資制限

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

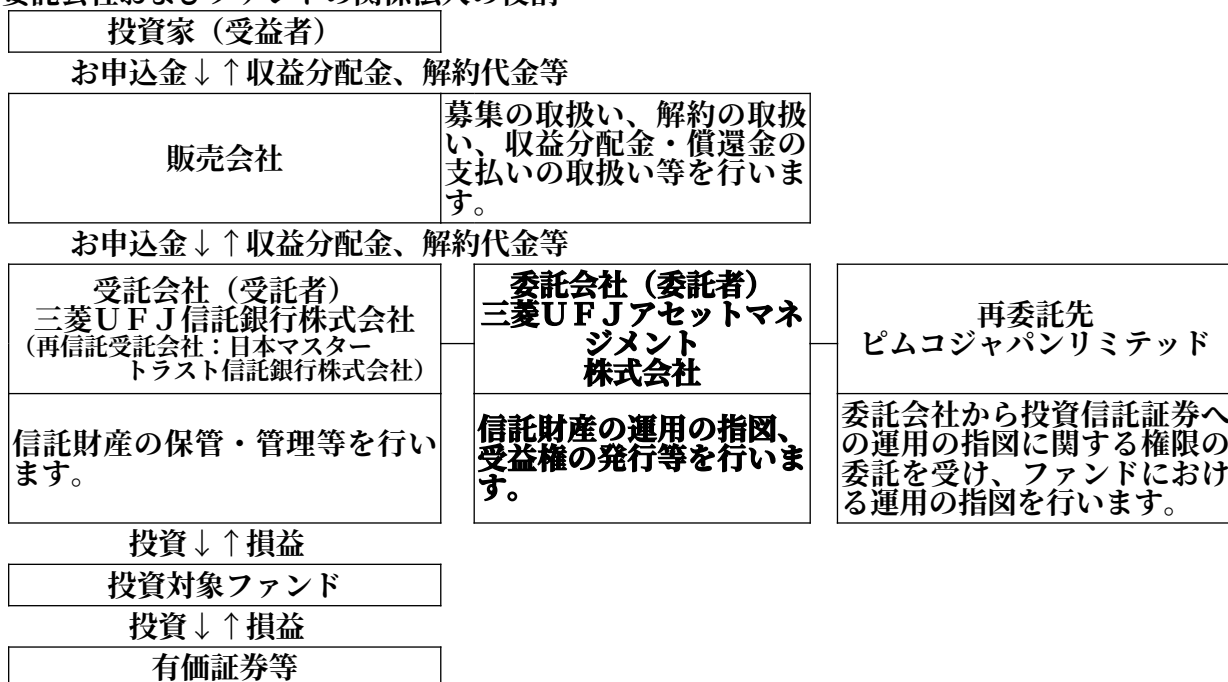
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2013年10月25日 設定日、信託契約締結、運用開始
 2022年6月8日 信託期間を2023年9月8日までから2028年9月8日までに変更

(3) 【ファンドの仕組み】

①委託会社およびファンドの関係法人の役割



②委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	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。
委託会社と再委託先との契約 「信託財産の運用指図権限委託契約」	運用指図権限委託の内容およびこれに係る事務の内容、再委託先が受ける報酬等が定められています。

③委託会社の概況（2024年9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
株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	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】

「三菱ＵＦＪ／ピムコ トータル・リターン・ファンド＜米ドルヘッジ型＞（毎月決算型）」

投資信託証券を主要投資対象とします。

主として円建ての外国投資信託であるピムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ（JPY, Hedged）の投資信託証券への投資を通じて、世界（新興国を含みます。）の米ドル建てを中心とする投資適格債券等を実質的な投資を行い、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。なお、証券投資信託であるマネー・マーケット・マザーファンドの投資信託証券への投資も行います。

当ファンドの運用目標を達成するため、グローバル債券運用で長期の実績を有し、債券運用に強みを持つ会社であるピムコ社が運用を行う「ピムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ（JPY, Hedged）」を選定しました。また、余裕資金の運用については、取得・処分に係る利便性および余裕資金運用に適する資産を投資対象としていることを重視し、「マネー・マーケット・マザーファンド」を選定しました。

円建ての外国投資信託への投資は高位を維持することを基本とします。

投資信託証券への運用の指図に関する権限は、ピムコジャパンリミテッドに委託します。^(注)

原則として、投資する外国投資信託においては、当該外国投資信託の純資産総額を米ドル換算した額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行い、為替変動リスクの低減をはかります。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

「三菱ＵＦＪ／ピムコ トータル・リターン・ファンド＜為替ヘッジなし＞（毎月決算型）」

投資信託証券を主要投資対象とします。

主として円建ての外国投資信託であるピムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ（JPY）の投資信託証券への投資を通じて、世界（新興国を含みます。）の米ドル建てを中心とする投資適格債券等を実質的な投資を行い、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。なお、証券投資信託であるマネー・マーケット・マザーファンドの投資信託証券への投資も行います。

当ファンドの運用目標を達成するため、グローバル債券運用で長期の実績を有し、債券運用に強みを持つ会社であるピムコ社が運用を行う「ピムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ（JPY）」を選定しました。また、余裕資金の運用については、取得・処分に係る利便性および余裕資金運用に適する資産を投資対象としていることを重視し、「マネー・マーケット・

マザーファンド」を選定しました。

円建ての外国投資信託への投資は高位を維持することを基本とします。

投資信託証券への運用の指図に関する権限は、ピムコジャパンリミテッドに委託します。^(注)

実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

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

(2) 【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. 約束手形

ハ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

②有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、別に定める投資信託証券（投資信託および外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）ならびに投資証券および外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）をいいます。以下同じ。）のほか、次に掲げるものとします。なお、当該有価証券は本邦通貨表示のものに限ります。

1. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）

2. コマーシャル・ペーパー

3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、2. の証券の性質を有するもの

4. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、1. の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は短期社債等への投資ならびに買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができます。

③金融商品の指図範囲

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

1. 預金

2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

<投資信託証券の概要>

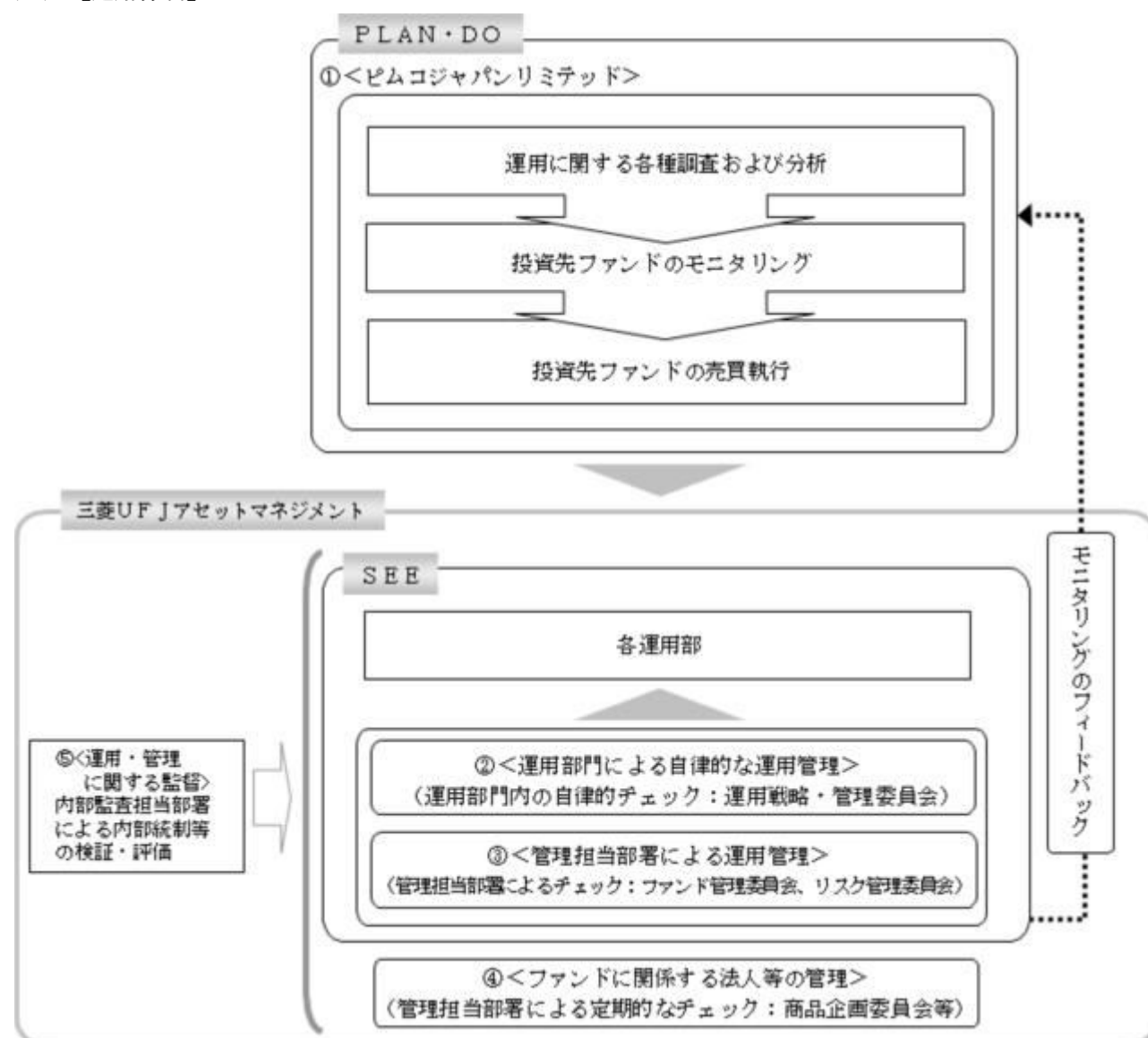
ピムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ (JPY, Hedged) ピムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ (JPY)					
形態	ルクセンブルグ籍・内建外国投資信託				
投資態度	ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンドへの投資を通じて、様々な償還期限の債券等を実質的に分散投資を行い、最大限のトータル・リターンを追求します。				
主な投資対象	様々な償還期限の債券等				
主な投資制限	・通常、総資産の65%以上を様々な償還期限の債券等（その派生商品等を含みます。）に分散投資します。 ・投資適格未満の債券等への投資比率は、総資産の20%以内とします。ただし、投資する債券等は取得時においてB-格相当以上の格付けを取得しているものに限りします。 ・米ドル以外の通貨建ての有価証券への投資比率は、総資産の30%以内とします。ただし、米ドル以外の通貨への実質的な投資比率は、原則として総資産の20%以内とします。 ・新興国関連有価証券等への投資比率は、総資産の15%以内とします。 ・ポートフォリオの平均デュレーション^{※1}は、原則としてブルームバーグ米国総合インデックス^{※2}のデュレーション±2年以内で調整します。 ※1 デュレーションとは、債券の投資元本の回収に要する平均残存期間や金利感応度を意味する指標です。この値が大きいほど、金利変動に対する債券価格の変動率が大きくなります。 ※2 ブルームバーグ米国総合インデックスとは、ブルームバーグが算出する米ドル建ての投資適格債券の値動きを表す指数です。ブルームバーグ(BLOOMBERG)は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー(Bloomberg Finance L.P.)の商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・インデックス(BLOOMBERG INDICES)に対する一切の独占的権利を有しています。 ・デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。 ・各クラスにおいて、保有外貨建て資産に対し、以下の為替対応を行います。 <table border="1"> <tr> <td>クラスJ (JPY, Hedged)</td><td>原則として、当該外国投資信託の純資産総額を米ドル換算した額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行います。</td></tr> <tr> <td>クラスJ (JPY)</td><td>原則として、為替ヘッジを行いません。</td></tr> </table>	クラスJ (JPY, Hedged)	原則として、当該外国投資信託の純資産総額を米ドル換算した額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行います。	クラスJ (JPY)	原則として、為替ヘッジを行いません。
クラスJ (JPY, Hedged)	原則として、当該外国投資信託の純資産総額を米ドル換算した額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行います。				
クラスJ (JPY)	原則として、為替ヘッジを行いません。				
運用管理費用（信託報酬）	ありません。				
その他の費用・手数料	税金、法律関係の費用、監査費用、有価証券等の売買に係る手数料、設立費用、保管費用、借入金・立替金の利息等がかかる場合があります。				
購入時手数料	ありません。				
信託財産留保額	ありません。				
投資運用会社	Pacific Investment Management Company LLC (PIMCO)				
設定日	2013年10月25日				
決算日	原則として毎年5月31日				
分配方針	原則として毎月分配を行う方針です。				

原則として「ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド」の投資信託証券を通じて実質的な投資を行います。なお、「ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド」においては運用管理費用（信託報酬）、購入時手数料および信託財産留保額はかかりません。

マネー・マーケット・マザーファンド	
形態	証券投資信託
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
投資態度	わが国の短期公社債等を中心に投資し、利子等収益の確保を図ります。 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。
主な投資対象	わが国の公社債等

主な投資制限	・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。 ・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。
運用管理費用（信託報酬）	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
設定日	2005年3月4日
決算日	原則として毎年5月および11月の20日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

（３）【運用体制】



①運用の指図に関する権限の委託

当ファンドは投資信託証券への運用の指図に関する権限を、ピムコジャパンリミテッド（「再委託先」といいます。）に委託しています。再委託先は与えられた投資信託証券への運用の指図に関する権限の範囲内で投資戦略を策定し、ポートフォリオの構築を行います。

②運用部門による自律的な運用管理

委託会社では、各運用部の担当ファンドマネジャーが日々再委託先の運用の適切性を確認しているほか、運用部門としても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。

③管理担当部署による運用管理

委託会社では、運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）が、（a）運用に関するパフォーマンス測定・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。その内容は更に運用部門から再委託先に還元されます。

④ファンドに関係する法人等の管理

再委託先、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。

⑤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/investment_policy/fm.html

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。ただし、第２決算時までの間は、収益の分配は行いません。

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

（５）【投資制限】

<信託約款に定められた投資制限>

- ①株式
株式への直接投資は行いません。
- ②外貨建資産
外貨建資産への直接投資は行いません。
- ③投資信託証券
投資信託証券への投資割合に制限を設けません。
- ④信用取引
信用取引の指図は行いません。

⑤公社債の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. a. の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

⑥資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

⑦信用リスクの分散規制

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

3【投資リスク】

（1）投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

（主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。）

①価格変動リスク

一般に、公社債等の価格は市場金利の変動等を受けて変動するため、当ファンドはその影響を受け公社債等の価格が下落した場合には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。

また、転換社債は、株式および債券の両方の性格を有しており、株式および債券の価格変動の影響を受け、組入転換社債の価格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。

②為替変動リスク

「三菱UFJ／ピムコ トータル・リターン・ファンド＜米ドルヘッジ型＞（毎月決算型）」

実質的な組入外貨建資産の米ドル換算した額については、米ドル売り、円買いの為替取引を行い、円に対する米ドルの為替変動リスクの低減を図りますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。また、組入外貨のうち、米ドル以外の通貨については、米ドルに対する当該通貨の為替変動の影響を受けます。なお、円の金利が米ドルの金利より低いときには、これらの金利差相当分が為替取引によるコストとなります。ただし、為替市場の

状況によっては、金利差相当分以上の為替取引によるコストとなる場合があります。

「三菱UFJ／ピムコ トータル・リターン・ファンド＜為替ヘッジなし＞（毎月決算型）」

実質的な主要投資対象である海外の公社債は外貨建資産であり、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。そのため、為替相場が円高方向に進んだ場合には、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。

③信用リスク

信用リスクとは、有価証券等（バンクローンを含みます。以下同じ。）の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等に、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払いや償還金の支払いが滞る等の債務が不履行となること等をいいます。当ファンドは、信用リスクを伴い、その影響を受けますので、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。

④流動性リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない、または取引が不可能となるリスクのことを流動性リスクといい、当ファンドはそのリスクを伴います。例えば、組み入れている公社債の売却を十分な流動性の下で行えないときは、市場実勢から期待される価格で売却できない可能性があります。この場合、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。また、バンクローンは、公社債と比べ、一般的に取引量も少ないため、流動性リスクも高い傾向にあります。

⑤カントリーリスク

新興国への投資は、先進国への投資を行う場合に比べ、投資対象国におけるクーデターや重大な政治体制の変更、資産凍結を含む重大な規制の導入、政府のデフォルト等の発生による影響を受けることにより、価格変動・為替変動・信用・流動性の各リスクが大きくなる可能性があります。この場合、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込む可能性が高まる場合があります。

当ファンドは、格付けの低い公社債等も投資対象としており、格付けの高い公社債等への投資を行う場合に比べ、価格変動・信用・流動性の各リスクが大きくなる可能性があります。

※留意事項

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付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。
- ・投資対象ファンドにおいては、信用リスク管理上、政府機関の発行または保証する有価証券、およびそれらと同等と判断した銘柄^(※)について、同一発行体でファンドの純資産総額の10%を超えて保有する場合があります。
(※)には、米国の連邦住宅抵当公庫（ファニーメイ：FNMA）および連邦住宅抵当貸付公社（フレディ・マック：FHLMC）が発行または保証するモーゲージ証券等が該当します。

（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検討しています。

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。

①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。

②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。

③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。

〔再委託先の管理体制〕

リスク管理およびコンプライアンスの機能は、運用部門から独立したコンプライアンスおよびオペレーション・リスク管理部門によって実施しております。同部門により、全てのファンドについて投資ガイドライン違反やリスク管理指標からの逸脱がないかどうかのチェックを行なっています。

また、このほかに、投資ガイドラインなどに関するチェックの機能としては、コンプライアンス・スクリーニング・システムにより売買執行前および執行後のモニタリングを行いチェックします。

＜投資対象ファンド（国内投資信託を除く）の信用リスク管理方法＞

投資対象ファンドの管理会社および投資運用会社は、投資対象ファンドにおいて、欧州委員会が制定した指令（UCITS指令）に定めるリスク管理方法に基づき信用リスクを管理します。

〔委託会社における再委託先に対する確認体制〕

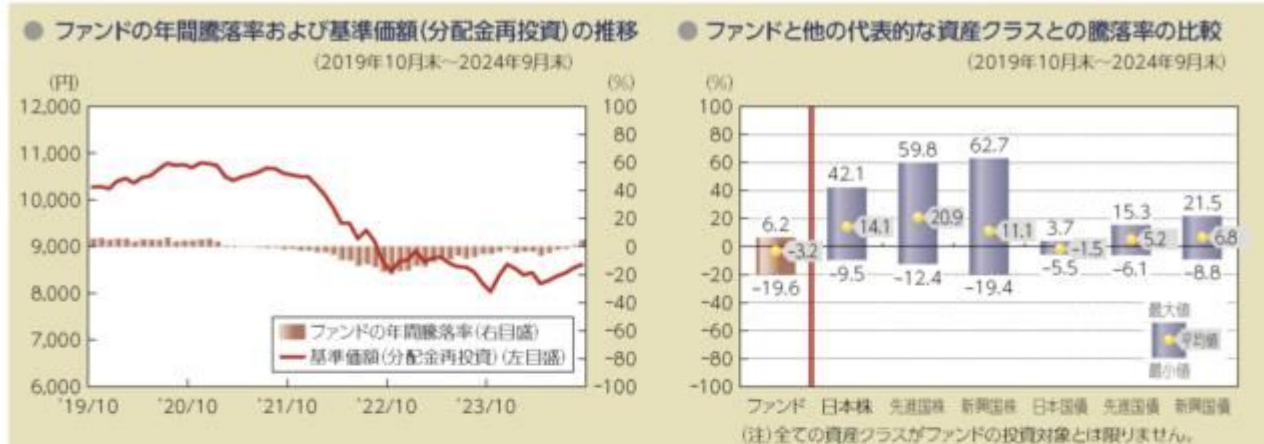
委託会社と再委託先の間で、再委託先がファンド運用コンセプトを維持し、適切に投資リスク管理が図られるよう運用指図権限委託契約として委託内容を定めています。また、委託会社は再委託先に対し定期的に書面による調査等を実施し、投資リスクに対する管理体制の確認を行っています。

また、再委託先からの定期的なデータ還元を受け、ファンドのリスクの運営状況の確認を行っているほか、委託会社自身でもモニタリングし、投資リスクを管理しています。

■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。

<米ドルヘッジ型> (毎月決算型)



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

<為替ヘッジなし> (毎月決算型)



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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

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

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込価額（発行価格）×2.2%（税抜 2%）を上限として販売会社が定める手数料率

申込手数料は販売会社にご確認ください。

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、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

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

(2)【換金（解約）手数料】

かかりません。

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

(3)【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年1.54%（税抜1.4%）の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

1万口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額×信託報酬率×（保有日数／365）

※上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

- ・信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

- ・信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.77%	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等
販売会社	0.6%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等
受託会社	0.03%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

※上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

再委託先が受ける報酬は、委託会社が受ける報酬から、原則として、毎年3、6、9、12月の15日（該当日が休業日のときは、該当日の翌営業日とします。）および信託終了のときから3ヵ月以内に支払われ、その報酬額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.539%以内（税抜 年0.49%以内）の率を乗じて得た金額とします。

ファンドが投資対象とする投資信託証券では信託報酬はかかりませんので、受益者が負担する実質的な信託報酬は上記と同じです。

（４）【その他の手数料等】

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

投資対象とする投資信託証券には監査費用等の諸費用が別途かかります。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

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

１．収益分配金の課税

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

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

２．解約時および償還時の課税

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

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

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15%、復興特別所得税

0.315%、地方税5%)の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

※公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に「NISA（少額投資非課税制度）」の適用対象となります。ファンドは、NISAの対象ではありません。

②法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

◇個別元本について

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

◇収益分配金について

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

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

※上記は2024年9月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

(参考情報) ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間(以下「当期間」といいます。)(2024年3月9日～2024年9月9日)における当ファンドの総経費率は以下の通りです。

	総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
<米ドルヘッジ型>(毎月決算型)	1.54%	1.54%	0.00%
<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	1.54%	1.54%	0.00%

(比率は年率、表示桁数未満四捨五入)

※当期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。消費税等のかかるものは消費税等を含む。)を当期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除しています。
※投資先ファンドの費用は対象期間が異なる場合があります。
※入手し得る情報において含まれていない費用はありません。
詳細につきましては、当期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

【三菱UFJ／ピムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型>（毎月決算型）】

(1)【投資状況】

2024年 9月30日現在
(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
投資信託受益証券	ルクセンブルク	886,134,512	99.08
親投資信託受益証券	日本	1,439,139	0.16
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	6,802,313	0.76
純資産総額		894,375,964	100.00

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

(2)【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

2024年 9月30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 (%)
ルクセンブルク	投資信託受益証券	ピムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ (JPY, Hedged)	114,222.0305	7,743	884,421,182	7,758	886,134,512	99.08
日本	親投資信託受益証券	マネー・マーケット・マザーファンド	1,412,860	1.0185	1,438,997	1.0186	1,439,139	0.16

(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

2024年 9月30日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	99.08
親投資信託受益証券	0.16
合計	99.24

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

下記計算期間末日および2024年9月末日、同日前１年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

		純資産総額		基準価額 (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11計算期間末日	(2014年10月 8日)	1,845,170,110	1,848,888,269	9,925	9,945
第12計算期間末日	(2014年11月10日)	1,845,517,389	1,849,230,251	9,941	9,961
第13計算期間末日	(2014年12月 8日)	1,812,421,875	1,816,065,644	9,948	9,968
第14計算期間末日	(2015年 1月 8日)	1,752,981,268	1,756,486,559	10,002	10,022
第15計算期間末日	(2015年 2月 9日)	1,691,340,673	1,694,708,502	10,044	10,064
第16計算期間末日	(2015年 3月 9日)	1,593,964,227	1,597,172,295	9,937	9,957
第17計算期間末日	(2015年 4月 8日)	1,495,958,143	1,498,934,370	10,053	10,073
第18計算期間末日	(2015年 5月 8日)	1,500,071,810	1,503,116,299	9,854	9,874
第19計算期間末日	(2015年 6月 8日)	1,469,763,689	1,472,774,045	9,765	9,785
第20計算期間末日	(2015年 7月 8日)	1,453,931,439	1,456,900,868	9,793	9,813
第21計算期間末日	(2015年 8月10日)	1,548,775,058	1,551,932,660	9,810	9,830
第22計算期間末日	(2015年 9月 8日)	1,547,732,971	1,550,920,998	9,710	9,730
第23計算期間末日	(2015年10月 8日)	1,537,774,045	1,540,935,497	9,728	9,748
第24計算期間末日	(2015年11月 9日)	1,515,256,142	1,518,401,861	9,634	9,654
第25計算期間末日	(2015年12月 8日)	1,663,343,833	1,666,790,961	9,651	9,671
第26計算期間末日	(2016年 1月 8日)	1,804,285,405	1,808,048,420	9,590	9,610
第27計算期間末日	(2016年 2月 8日)	1,828,779,920	1,832,587,550	9,606	9,626
第28計算期間末日	(2016年 3月 8日)	1,948,671,102	1,952,747,586	9,561	9,581
第29計算期間末日	(2016年 4月 8日)	2,145,939,209	2,150,365,516	9,696	9,716
第30計算期間末日	(2016年 5月 9日)	2,549,355,114	2,554,630,378	9,665	9,685
第31計算期間末日	(2016年 6月 8日)	3,082,264,213	3,088,627,259	9,688	9,708
第32計算期間末日	(2016年 7月 8日)	4,040,254,719	4,048,500,461	9,800	9,820
第33計算期間末日	(2016年 8月 8日)	5,032,130,102	5,042,447,001	9,755	9,775
第34計算期間末日	(2016年 9月 8日)	5,702,748,263	5,714,420,436	9,772	9,792
第35計算期間末日	(2016年10月11日)	6,548,108,494	6,561,639,764	9,678	9,698
第36計算期間末日	(2016年11月 8日)	7,387,807,446	7,403,135,715	9,639	9,659
第37計算期間末日	(2016年12月 8日)	8,161,450,938	8,178,846,103	9,384	9,404
第38計算期間末日	(2017年 1月10日)	9,038,794,547	9,058,071,509	9,378	9,398
第39計算期間末日	(2017年 2月 8日)	9,040,278,561	9,059,494,338	9,409	9,429

第40計算期間末日	(2017年 3月 8日)	8,740,411,524	8,759,164,265	9,322	9,342
第41計算期間末日	(2017年 4月10日)	7,933,709,443	7,950,650,525	9,366	9,386
第42計算期間末日	(2017年 5月 8日)	7,527,079,171	7,543,145,480	9,370	9,390
第43計算期間末日	(2017年 6月 8日)	7,181,533,663	7,196,783,919	9,418	9,438
第44計算期間末日	(2017年 7月10日)	6,774,227,340	6,788,719,199	9,349	9,369
第45計算期間末日	(2017年 8月 8日)	6,513,323,341	6,527,149,629	9,422	9,442
第46計算期間末日	(2017年 9月 8日)	6,338,271,203	6,351,627,086	9,491	9,511
第47計算期間末日	(2017年10月10日)	5,966,119,187	5,978,839,366	9,381	9,401
第48計算期間末日	(2017年11月 8日)	5,715,695,933	5,727,886,882	9,377	9,397
第49計算期間末日	(2017年12月 8日)	5,416,130,004	5,427,772,664	9,304	9,324
第50計算期間末日	(2018年 1月 9日)	5,231,147,597	5,236,785,962	9,278	9,288
第51計算期間末日	(2018年 2月 8日)	4,979,119,620	4,984,586,058	9,109	9,119
第52計算期間末日	(2018年 3月 8日)	4,799,108,093	4,804,413,623	9,045	9,055
第53計算期間末日	(2018年 4月 9日)	4,692,104,054	4,697,280,748	9,064	9,074
第54計算期間末日	(2018年 5月 8日)	4,492,990,010	4,498,014,260	8,943	8,953
第55計算期間末日	(2018年 6月 8日)	4,419,287,980	4,424,242,304	8,920	8,930
第56計算期間末日	(2018年 7月 9日)	4,320,247,101	4,325,077,446	8,944	8,954
第57計算期間末日	(2018年 8月 8日)	4,212,659,648	4,217,387,050	8,911	8,921
第58計算期間末日	(2018年 9月10日)	4,071,598,183	4,076,211,484	8,826	8,836
第59計算期間末日	(2018年10月 9日)	3,939,709,824	3,944,228,756	8,718	8,728
第60計算期間末日	(2018年11月 8日)	3,771,740,601	3,776,078,631	8,695	8,705
第61計算期間末日	(2018年12月10日)	3,694,403,795	3,698,622,228	8,758	8,768
第62計算期間末日	(2019年 1月 8日)	3,656,164,871	3,660,329,756	8,779	8,789
第63計算期間末日	(2019年 2月 8日)	3,646,996,391	3,651,111,427	8,863	8,873
第64計算期間末日	(2019年 3月 8日)	3,626,138,344	3,630,242,378	8,836	8,846
第65計算期間末日	(2019年 4月 8日)	3,610,983,435	3,615,042,113	8,897	8,907
第66計算期間末日	(2019年 5月 8日)	3,539,895,243	3,543,865,028	8,917	8,927
第67計算期間末日	(2019年 6月10日)	3,536,047,557	3,539,964,234	9,028	9,038
第68計算期間末日	(2019年 7月 8日)	3,528,245,366	3,532,151,240	9,033	9,043
第69計算期間末日	(2019年 8月 8日)	3,574,145,178	3,578,046,345	9,162	9,172
第70計算期間末日	(2019年 9月 9日)	3,575,982,829	3,579,858,940	9,226	9,236
第71計算期間末日	(2019年10月 8日)	3,521,219,381	3,525,044,815	9,205	9,215
第72計算期間末日	(2019年11月 8日)	3,418,033,472	3,419,924,667	9,037	9,042
第73計算期間末日	(2019年12月 9日)	3,392,128,851	3,393,999,284	9,068	9,073
第74計算期間末日	(2020年 1月 8日)	3,367,984,153	3,369,839,585	9,076	9,081
第75計算期間末日	(2020年 2月10日)	3,366,538,182	3,368,371,169	9,183	9,188
第76計算期間末日	(2020年 3月 9日)	3,381,395,116	3,383,185,830	9,441	9,446
第77計算期間末日	(2020年 4月 8日)	3,240,025,636	3,241,799,511	9,133	9,138
第78計算期間末日	(2020年 5月 8日)	3,259,549,870	3,261,312,411	9,247	9,252
第79計算期間末日	(2020年 6月 8日)	3,260,990,860	3,262,749,081	9,274	9,279
第80計算期間末日	(2020年 7月 8日)	3,240,489,429	3,242,210,522	9,414	9,419
第81計算期間末日	(2020年 8月11日)	3,139,010,215	3,140,659,614	9,516	9,521

第82計算期間末日	(2020年 9月 8日)	3,071,466,281	3,073,088,967	9,464	9,469
第83計算期間末日	(2020年10月 8日)	3,012,024,655	3,013,623,111	9,422	9,427
第84計算期間末日	(2020年11月 9日)	2,950,054,884	2,951,617,556	9,439	9,444
第85計算期間末日	(2020年12月 8日)	2,869,071,160	2,870,586,685	9,466	9,471
第86計算期間末日	(2021年 1月 8日)	2,810,440,734	2,811,932,503	9,420	9,425
第87計算期間末日	(2021年 2月 8日)	2,748,656,625	2,750,119,225	9,396	9,401
第88計算期間末日	(2021年 3月 8日)	2,644,465,798	2,645,902,631	9,202	9,207
第89計算期間末日	(2021年 4月 8日)	2,586,364,806	2,587,773,314	9,181	9,186
第90計算期間末日	(2021年 5月10日)	2,585,292,695	2,586,692,501	9,234	9,239
第91計算期間末日	(2021年 6月 8日)	2,563,280,365	2,564,666,707	9,245	9,250
第92計算期間末日	(2021年 7月 8日)	2,580,775,840	2,582,158,127	9,335	9,340
第93計算期間末日	(2021年 8月10日)	2,445,557,189	2,446,869,737	9,316	9,321
第94計算期間末日	(2021年 9月 8日)	2,402,547,188	2,403,838,272	9,304	9,309
第95計算期間末日	(2021年10月 8日)	2,344,866,480	2,346,138,003	9,221	9,226
第96計算期間末日	(2021年11月 8日)	2,295,505,732	2,296,745,115	9,261	9,266
第97計算期間末日	(2021年12月 8日)	2,228,568,837	2,229,783,049	9,177	9,182
第98計算期間末日	(2022年 1月11日)	2,188,387,782	2,189,595,459	9,060	9,065
第99計算期間末日	(2022年 2月 8日)	2,127,408,222	2,128,601,998	8,910	8,915
第100計算期間末日	(2022年 3月 8日)	2,104,454,803	2,105,646,751	8,828	8,833
第101計算期間末日	(2022年 4月 8日)	1,983,763,420	1,984,938,189	8,443	8,448
第102計算期間末日	(2022年 5月 9日)	1,891,638,725	1,892,804,133	8,116	8,121
第103計算期間末日	(2022年 6月 8日)	1,892,447,543	1,893,605,950	8,168	8,173
第104計算期間末日	(2022年 7月 8日)	1,846,820,150	1,847,977,413	7,979	7,984
第105計算期間末日	(2022年 8月 8日)	1,845,288,139	1,846,435,250	8,043	8,048
第106計算期間末日	(2022年 9月 8日)	1,788,910,648	1,790,051,036	7,843	7,848
第107計算期間末日	(2022年10月11日)	1,698,710,785	1,699,848,451	7,466	7,471
第108計算期間末日	(2022年11月 8日)	1,644,812,621	1,645,942,141	7,281	7,286
第109計算期間末日	(2022年12月 8日)	1,726,696,572	1,727,818,688	7,694	7,699
第110計算期間末日	(2023年 1月10日)	1,713,581,382	1,714,701,598	7,648	7,653
第111計算期間末日	(2023年 2月 8日)	1,715,590,218	1,716,708,815	7,668	7,673
第112計算期間末日	(2023年 3月 8日)	1,667,437,769	1,668,554,855	7,463	7,468
第113計算期間末日	(2023年 4月10日)	1,708,291,287	1,709,402,506	7,687	7,692
第114計算期間末日	(2023年 5月 8日)	1,682,892,954	1,683,998,530	7,611	7,616
第115計算期間末日	(2023年 6月 8日)	1,469,965,013	1,470,952,777	7,441	7,446
第116計算期間末日	(2023年 7月10日)	1,413,373,121	1,414,339,153	7,315	7,320
第117計算期間末日	(2023年 8月 8日)	1,412,156,437	1,413,119,180	7,334	7,339
第118計算期間末日	(2023年 9月 8日)	1,375,966,865	1,376,918,050	7,233	7,238
第119計算期間末日	(2023年10月10日)	1,318,054,746	1,319,000,189	6,971	6,976
第120計算期間末日	(2023年11月 8日)	1,290,272,482	1,291,185,818	7,064	7,069
第121計算期間末日	(2023年12月 8日)	1,317,897,363	1,318,803,651	7,271	7,276
第122計算期間末日	(2024年 1月 9日)	1,318,167,463	1,319,068,272	7,317	7,322
第123計算期間末日	(2024年 2月 8日)	1,306,995,279	1,307,892,603	7,283	7,288

第124計算期間末日	(2024年 3月 8日)	1,285,397,258	1,286,280,493	7,277	7,282
第125計算期間末日	(2024年 4月 8日)	1,260,499,818	1,261,378,823	7,170	7,175
第126計算期間末日	(2024年 5月 8日)	1,216,882,020	1,217,735,477	7,129	7,134
第127計算期間末日	(2024年 6月10日)	1,198,520,228	1,199,361,477	7,123	7,128
第128計算期間末日	(2024年 7月 8日)	1,187,991,566	1,188,819,811	7,172	7,177
第129計算期間末日	(2024年 8月 8日)	891,939,542	892,553,430	7,265	7,270
第130計算期間末日	(2024年 9月 9日)	895,604,615	896,213,723	7,352	7,357
2023年 9月末日		1,338,751,075	—	7,080	—
10月末日		1,277,157,920	—	6,914	—
11月末日		1,306,115,520	—	7,206	—
12月末日		1,336,415,557	—	7,412	—
2024年 1月末日		1,321,722,342	—	7,327	—
2月末日		1,285,251,192	—	7,205	—
3月末日		1,276,155,776	—	7,245	—
4月末日		1,212,232,919	—	7,038	—
5月末日		1,194,037,767	—	7,089	—
6月末日		1,190,536,193	—	7,164	—
7月末日		893,671,873	—	7,217	—
8月末日		890,637,848	—	7,304	—
9月末日		894,375,964	—	7,359	—

②【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第11計算期間	20円
第12計算期間	20円
第13計算期間	20円
第14計算期間	20円
第15計算期間	20円
第16計算期間	20円
第17計算期間	20円
第18計算期間	20円
第19計算期間	20円
第20計算期間	20円
第21計算期間	20円
第22計算期間	20円
第23計算期間	20円
第24計算期間	20円
第25計算期間	20円
第26計算期間	20円
第27計算期間	20円
第28計算期間	20円
第29計算期間	20円

第30計算期間	20円
第31計算期間	20円
第32計算期間	20円
第33計算期間	20円
第34計算期間	20円
第35計算期間	20円
第36計算期間	20円
第37計算期間	20円
第38計算期間	20円
第39計算期間	20円
第40計算期間	20円
第41計算期間	20円
第42計算期間	20円
第43計算期間	20円
第44計算期間	20円
第45計算期間	20円
第46計算期間	20円
第47計算期間	20円
第48計算期間	20円
第49計算期間	20円
第50計算期間	10円
第51計算期間	10円
第52計算期間	10円
第53計算期間	10円
第54計算期間	10円
第55計算期間	10円
第56計算期間	10円
第57計算期間	10円
第58計算期間	10円
第59計算期間	10円
第60計算期間	10円
第61計算期間	10円
第62計算期間	10円
第63計算期間	10円
第64計算期間	10円
第65計算期間	10円
第66計算期間	10円
第67計算期間	10円
第68計算期間	10円
第69計算期間	10円
第70計算期間	10円
第71計算期間	10円

第72計算期間	5円
第73計算期間	5円
第74計算期間	5円
第75計算期間	5円
第76計算期間	5円
第77計算期間	5円
第78計算期間	5円
第79計算期間	5円
第80計算期間	5円
第81計算期間	5円
第82計算期間	5円
第83計算期間	5円
第84計算期間	5円
第85計算期間	5円
第86計算期間	5円
第87計算期間	5円
第88計算期間	5円
第89計算期間	5円
第90計算期間	5円
第91計算期間	5円
第92計算期間	5円
第93計算期間	5円
第94計算期間	5円
第95計算期間	5円
第96計算期間	5円
第97計算期間	5円
第98計算期間	5円
第99計算期間	5円
第100計算期間	5円
第101計算期間	5円
第102計算期間	5円
第103計算期間	5円
第104計算期間	5円
第105計算期間	5円
第106計算期間	5円
第107計算期間	5円
第108計算期間	5円
第109計算期間	5円
第110計算期間	5円
第111計算期間	5円
第112計算期間	5円
第113計算期間	5円

第114計算期間	5円
第115計算期間	5円
第116計算期間	5円
第117計算期間	5円
第118計算期間	5円
第119計算期間	5円
第120計算期間	5円
第121計算期間	5円
第122計算期間	5円
第123計算期間	5円
第124計算期間	5円
第125計算期間	5円
第126計算期間	5円
第127計算期間	5円
第128計算期間	5円
第129計算期間	5円
第130計算期間	5円

③【収益率の推移】

	収益率（％）
第11計算期間	△0.06
第12計算期間	0.36
第13計算期間	0.27
第14計算期間	0.74
第15計算期間	0.61
第16計算期間	△0.86
第17計算期間	1.36
第18計算期間	△1.78
第19計算期間	△0.70
第20計算期間	0.49
第21計算期間	0.37
第22計算期間	△0.81
第23計算期間	0.39
第24計算期間	△0.76
第25計算期間	0.38
第26計算期間	△0.42
第27計算期間	0.37
第28計算期間	△0.26
第29計算期間	1.62
第30計算期間	△0.11
第31計算期間	0.44
第32計算期間	1.36

第33計算期間	△0.25
第34計算期間	0.37
第35計算期間	△0.75
第36計算期間	△0.19
第37計算期間	△2.43
第38計算期間	0.14
第39計算期間	0.54
第40計算期間	△0.71
第41計算期間	0.68
第42計算期間	0.25
第43計算期間	0.72
第44計算期間	△0.52
第45計算期間	0.99
第46計算期間	0.94
第47計算期間	△0.94
第48計算期間	0.17
第49計算期間	△0.56
第50計算期間	△0.17
第51計算期間	△1.71
第52計算期間	△0.59
第53計算期間	0.32
第54計算期間	△1.22
第55計算期間	△0.14
第56計算期間	0.38
第57計算期間	△0.25
第58計算期間	△0.84
第59計算期間	△1.11
第60計算期間	△0.14
第61計算期間	0.83
第62計算期間	0.35
第63計算期間	1.07
第64計算期間	△0.19
第65計算期間	0.80
第66計算期間	0.33
第67計算期間	1.35
第68計算期間	0.16
第69計算期間	1.53
第70計算期間	0.80
第71計算期間	△0.11
第72計算期間	△1.77
第73計算期間	0.39
第74計算期間	0.14

第75計算期間	1.23
第76計算期間	2.86
第77計算期間	△3.20
第78計算期間	1.30
第79計算期間	0.34
第80計算期間	1.56
第81計算期間	1.13
第82計算期間	△0.49
第83計算期間	△0.39
第84計算期間	0.23
第85計算期間	0.33
第86計算期間	△0.43
第87計算期間	△0.20
第88計算期間	△2.01
第89計算期間	△0.17
第90計算期間	0.63
第91計算期間	0.17
第92計算期間	1.02
第93計算期間	△0.14
第94計算期間	△0.07
第95計算期間	△0.83
第96計算期間	0.48
第97計算期間	△0.85
第98計算期間	△1.22
第99計算期間	△1.60
第100計算期間	△0.86
第101計算期間	△4.30
第102計算期間	△3.81
第103計算期間	0.70
第104計算期間	△2.25
第105計算期間	0.86
第106計算期間	△2.42
第107計算期間	△4.74
第108計算期間	△2.41
第109計算期間	5.74
第110計算期間	△0.53
第111計算期間	0.32
第112計算期間	△2.60
第113計算期間	3.06
第114計算期間	△0.92
第115計算期間	△2.16
第116計算期間	△1.62

第117計算期間	0.32
第118計算期間	△1.30
第119計算期間	△3.55
第120計算期間	1.40
第121計算期間	3.00
第122計算期間	0.70
第123計算期間	△0.39
第124計算期間	△0.01
第125計算期間	△1.40
第126計算期間	△0.50
第127計算期間	△0.01
第128計算期間	0.75
第129計算期間	1.36
第130計算期間	1.26

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第11計算期間	695,492,681	362,690,736	1,859,079,955
第12計算期間	13,523,347	16,172,190	1,856,431,112
第13計算期間	27,532,173	62,078,588	1,821,884,697
第14計算期間	17,038,894	86,277,750	1,752,645,841
第15計算期間	3,391,061	72,122,299	1,683,914,603
第16計算期間	10,225,181	90,105,761	1,604,034,023
第17計算期間	11,348,475	127,268,682	1,488,113,816
第18計算期間	75,497,108	41,366,247	1,522,244,677
第19計算期間	23,255,729	40,321,959	1,505,178,447
第20計算期間	26,656,555	47,120,345	1,484,714,657
第21計算期間	96,681,638	2,595,226	1,578,801,069
第22計算期間	37,495,734	22,283,017	1,594,013,786
第23計算期間	3,457,557	16,745,339	1,580,726,004
第24計算期間	10,436,045	18,302,454	1,572,859,595
第25計算期間	165,016,337	14,311,532	1,723,564,400
第26計算期間	167,252,225	9,309,059	1,881,507,566
第27計算期間	54,658,694	32,351,182	1,903,815,078
第28計算期間	136,949,327	2,522,123	2,038,242,282
第29計算期間	263,903,376	88,992,039	2,213,153,619
第30計算期間	455,022,166	30,543,551	2,637,632,234
第31計算期間	551,665,192	7,774,253	3,181,523,173
第32計算期間	983,983,471	42,635,173	4,122,871,471
第33計算期間	1,116,477,855	80,899,509	5,158,449,817
第34計算期間	809,687,331	132,050,368	5,836,086,780

第35計算期間	1,215,741,676	286,193,333	6,765,635,123
第36計算期間	1,264,748,656	366,249,204	7,664,134,575
第37計算期間	1,230,214,257	196,766,292	8,697,582,540
第38計算期間	1,260,941,927	320,043,306	9,638,481,161
第39計算期間	257,776,175	288,368,625	9,607,888,711
第40計算期間	203,977,964	435,495,808	9,376,370,867
第41計算期間	105,222,365	1,011,051,766	8,470,541,466
第42計算期間	113,175,858	550,562,684	8,033,154,640
第43計算期間	48,133,809	456,160,118	7,625,128,331
第44計算期間	53,604,186	432,802,543	7,245,929,974
第45計算期間	14,852,743	347,638,336	6,913,144,381
第46計算期間	8,673,550	243,876,407	6,677,941,524
第47計算期間	10,487,089	328,339,098	6,360,089,515
第48計算期間	10,846,248	275,461,004	6,095,474,759
第49計算期間	7,995,532	282,140,107	5,821,330,184
第50計算期間	16,600,264	199,564,862	5,638,365,586
第51計算期間	1,037,812	172,964,680	5,466,438,718
第52計算期間	3,091,178	163,999,321	5,305,530,575
第53計算期間	873,964	129,709,642	5,176,694,897
第54計算期間	7,408,121	159,852,994	5,024,250,024
第55計算期間	1,205,413	71,131,295	4,954,324,142
第56計算期間	5,390,451	129,368,799	4,830,345,794
第57計算期間	826,859	103,770,261	4,727,402,392
第58計算期間	3,353,542	117,454,567	4,613,301,367
第59計算期間	798,746	95,167,204	4,518,932,909
第60計算期間	787,740	181,689,692	4,338,030,957
第61計算期間	6,780,607	126,378,507	4,218,433,057
第62計算期間	5,253,967	58,801,553	4,164,885,471
第63計算期間	741,464	50,590,846	4,115,036,089
第64計算期間	7,459,412	18,461,085	4,104,034,416
第65計算期間	1,160,538	46,516,467	4,058,678,487
第66計算期間	684,849	89,577,777	3,969,785,559
第67計算期間	1,547,794	54,655,735	3,916,677,618
第68計算期間	5,020,932	15,824,476	3,905,874,074
第69計算期間	15,854,178	20,560,745	3,901,167,507
第70計算期間	3,690,483	28,746,841	3,876,111,149
第71計算期間	6,007,702	56,684,791	3,825,434,060
第72計算期間	672,912	43,715,327	3,782,391,645
第73計算期間	395,402	41,919,444	3,740,867,603
第74計算期間	934,346	30,937,867	3,710,864,082
第75計算期間	517,600	45,405,740	3,665,975,942
第76計算期間	694,952	85,241,871	3,581,429,023

第77計算期間	11,551,287	45,229,404	3,547,750,906
第78計算期間	346,041	23,014,169	3,525,082,778
第79計算期間	416,181	9,055,059	3,516,443,900
第80計算期間	1,673,702	75,930,677	3,442,186,925
第81計算期間	497,282	143,885,189	3,298,799,018
第82計算期間	822,537	54,248,625	3,245,372,930
第83計算期間	274,627	48,734,654	3,196,912,903
第84計算期間	310,502	71,878,156	3,125,345,249
第85計算期間	477,804	94,771,401	3,031,051,652
第86計算期間	891,427	48,404,833	2,983,538,246
第87計算期間	455,833	58,793,761	2,925,200,318
第88計算期間	237,356	51,771,523	2,873,666,151
第89計算期間	216,799	56,866,517	2,817,016,433
第90計算期間	229,141	17,631,784	2,799,613,790
第91計算期間	245,650	27,175,071	2,772,684,369
第92計算期間	230,265	8,339,093	2,764,575,541
第93計算期間	245,551	139,723,802	2,625,097,290
第94計算期間	215,299	43,143,281	2,582,169,308
第95計算期間	1,260,567	40,383,258	2,543,046,617
第96計算期間	247,124	64,525,925	2,478,767,816
第97計算期間	227,468	50,569,464	2,428,425,820
第98計算期間	244,483	13,314,355	2,415,355,948
第99計算期間	235,896	28,039,729	2,387,552,115
第100計算期間	229,133	3,885,214	2,383,896,034
第101計算期間	1,375,071	35,732,814	2,349,538,291
第102計算期間	241,385	18,961,987	2,330,817,689
第103計算期間	824,648	14,827,286	2,316,815,051
第104計算期間	253,877	2,542,454	2,314,526,474
第105計算期間	277,044	20,580,852	2,294,222,666
第106計算期間	256,648	13,701,979	2,280,777,335
第107計算期間	584,998	6,028,442	2,275,333,891
第108計算期間	402,438	16,696,191	2,259,040,138
第109計算期間	1,427,047	16,235,057	2,244,232,128
第110計算期間	1,610,390	5,409,403	2,240,433,115
第111計算期間	5,532,488	8,770,412	2,237,195,191
第112計算期間	254,422	3,276,094	2,234,173,519
第113計算期間	257,658	11,991,487	2,222,439,690
第114計算期間	241,325	11,528,148	2,211,152,867
第115計算期間	245,493	235,869,491	1,975,528,869
第116計算期間	312,103	43,776,368	1,932,064,604
第117計算期間	695,040	7,271,792	1,925,487,852
第118計算期間	416,527	23,533,803	1,902,370,576

第119計算期間	441,948	11,925,125	1,890,887,399
第120計算期間	480,939	64,695,503	1,826,672,835
第121計算期間	505,699	14,601,006	1,812,577,528
第122計算期間	1,215,938	12,175,440	1,801,618,026
第123計算期間	7,069,151	14,039,032	1,794,648,145
第124計算期間	616,924	28,793,381	1,766,471,688
第125計算期間	415,306	8,875,302	1,758,011,692
第126計算期間	976,919	52,073,207	1,706,915,404
第127計算期間	247,207	24,662,650	1,682,499,961
第128計算期間	231,027	26,239,511	1,656,491,477
第129計算期間	272,170	428,986,863	1,227,776,784
第130計算期間	210,005	9,769,183	1,218,217,606

【三菱UFJ／ピムコ トータル・リターン・ファンド＜為替ヘッジなし＞（毎月決算型）】

（１）【投資状況】

2024年 9月30日現在
（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
投資信託受益証券	ルクセンブルク	4,024,789,526	99.37
親投資信託受益証券	日本	5,512,480	0.14
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	19,963,294	0.49
純資産総額		4,050,265,300	100.00

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

2024年 9月30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 (%)
ルクセンブルク	投資信託受益証券	ピムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ（JPY）	346,039.8527	11,528	3,989,147,421	11,631	4,024,789,526	99.37
日本	親投資信託受益証券	マネー・マーケット・マザーファンド	5,411,821	1.0185	5,511,939	1.0186	5,512,480	0.14

（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

2024年 9月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.37
親投資信託受益証券	0.14
合計	99.51

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

下記計算期間末日および2024年9月末日、同日前１年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

		純資産総額		基準価額 (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11計算期間末日	(2014年10月 8日)	3,657,323,365	3,667,310,462	10,986	11,016
第12計算期間末日	(2014年11月10日)	3,816,073,908	3,825,886,179	11,667	11,697
第13計算期間末日	(2014年12月 8日)	3,678,236,677	3,687,193,799	12,319	12,349
第14計算期間末日	(2015年 1月 8日)	3,603,382,559	3,612,252,629	12,187	12,217
第15計算期間末日	(2015年 2月 9日)	3,530,533,279	3,539,217,786	12,196	12,226
第16計算期間末日	(2015年 3月 9日)	3,609,648,349	3,618,466,736	12,280	12,310
第17計算期間末日	(2015年 4月 8日)	3,389,882,901	3,398,126,504	12,336	12,366
第18計算期間末日	(2015年 5月 8日)	3,527,260,056	3,536,071,209	12,010	12,040
第19計算期間末日	(2015年 6月 8日)	3,639,693,568	3,648,420,605	12,512	12,542
第20計算期間末日	(2015年 7月 8日)	3,679,878,896	3,688,925,761	12,203	12,233
第21計算期間末日	(2015年 8月10日)	4,026,724,758	4,036,442,000	12,432	12,462
第22計算期間末日	(2015年 9月 8日)	4,197,441,665	4,208,109,777	11,804	11,834
第23計算期間末日	(2015年10月 8日)	4,362,115,131	4,373,107,711	11,905	11,935
第24計算期間末日	(2015年11月 9日)	4,415,668,169	4,441,299,463	12,059	12,129
第25計算期間末日	(2015年12月 8日)	5,561,813,078	5,594,124,040	12,049	12,119
第26計算期間末日	(2016年 1月 8日)	6,508,229,182	6,548,023,937	11,448	11,518
第27計算期間末日	(2016年 2月 8日)	7,307,903,811	7,353,115,290	11,315	11,385
第28計算期間末日	(2016年 3月 8日)	8,003,047,960	8,054,490,729	10,890	10,960
第29計算期間末日	(2016年 4月 8日)	8,941,663,295	9,001,448,444	10,469	10,539
第30計算期間末日	(2016年 5月 9日)	9,304,526,444	9,367,886,455	10,280	10,350
第31計算期間末日	(2016年 6月 8日)	10,053,248,170	10,121,466,789	10,316	10,386
第32計算期間末日	(2016年 7月 8日)	9,926,368,031	9,997,418,900	9,780	9,850
第33計算期間末日	(2016年 8月 8日)	10,071,506,700	10,143,454,435	9,799	9,869
第34計算期間末日	(2016年 9月 8日)	10,680,005,427	10,756,607,830	9,759	9,829
第35計算期間末日	(2016年10月11日)	11,568,499,493	11,651,413,086	9,767	9,837
第36計算期間末日	(2016年11月 8日)	12,244,247,760	12,331,515,538	9,821	9,891
第37計算期間末日	(2016年12月 8日)	12,130,992,292	12,212,974,597	10,358	10,428
第38計算期間末日	(2017年 1月10日)	11,770,422,673	11,848,231,846	10,589	10,659
第39計算期間末日	(2017年 2月 8日)	10,947,513,147	11,022,597,621	10,206	10,276
第40計算期間末日	(2017年 3月 8日)	10,930,965,289	11,005,744,116	10,232	10,302
第41計算期間末日	(2017年 4月10日)	10,434,477,852	10,507,846,812	9,955	10,025

第42計算期間末日	(2017年 5月 8日)	10,668,182,396	10,742,538,886	10,043	10,113
第43計算期間末日	(2017年 6月 8日)	10,360,903,448	10,434,798,087	9,815	9,885
第44計算期間末日	(2017年 7月10日)	10,325,822,341	10,397,267,205	10,117	10,187
第45計算期間末日	(2017年 8月 8日)	9,758,927,934	9,828,079,092	9,879	9,949
第46計算期間末日	(2017年 9月 8日)	9,681,724,137	9,751,529,010	9,709	9,779
第47計算期間末日	(2017年10月10日)	9,720,391,071	9,788,827,738	9,942	10,012
第48計算期間末日	(2017年11月 8日)	9,650,517,196	9,717,993,472	10,011	10,081
第49計算期間末日	(2017年12月 8日)	9,236,620,756	9,302,722,728	9,781	9,851
第50計算期間末日	(2018年 1月 9日)	9,065,967,689	9,130,997,686	9,759	9,829
第51計算期間末日	(2018年 2月 8日)	8,489,550,599	8,554,120,907	9,203	9,273
第52計算期間末日	(2018年 3月 8日)	8,036,458,003	8,100,236,546	8,820	8,890
第53計算期間末日	(2018年 4月 9日)	8,020,108,809	8,083,244,993	8,892	8,962
第54計算期間末日	(2018年 5月 8日)	7,971,926,361	8,034,590,085	8,905	8,975
第55計算期間末日	(2018年 6月 8日)	7,950,113,294	8,012,623,717	8,903	8,973
第56計算期間末日	(2018年 7月 9日)	7,931,235,450	7,993,464,078	8,922	8,992
第57計算期間末日	(2018年 8月 8日)	7,857,468,251	7,919,214,082	8,908	8,978
第58計算期間末日	(2018年 9月10日)	7,751,029,258	7,812,874,765	8,773	8,843
第59計算期間末日	(2018年10月 9日)	7,789,418,590	7,851,170,418	8,830	8,900
第60計算期間末日	(2018年11月 8日)	7,670,293,282	7,714,102,338	8,754	8,804
第61計算期間末日	(2018年12月10日)	7,608,709,185	7,652,206,367	8,746	8,796
第62計算期間末日	(2019年 1月 8日)	7,259,368,537	7,302,426,706	8,430	8,480
第63計算期間末日	(2019年 2月 8日)	7,355,056,838	7,397,840,420	8,596	8,646
第64計算期間末日	(2019年 3月 8日)	7,386,373,706	7,428,896,562	8,685	8,735
第65計算期間末日	(2019年 4月 8日)	7,396,023,831	7,438,328,358	8,741	8,791
第66計算期間末日	(2019年 5月 8日)	7,213,128,648	7,254,881,052	8,638	8,688
第67計算期間末日	(2019年 6月10日)	7,107,409,744	7,149,009,994	8,543	8,593
第68計算期間末日	(2019年 7月 8日)	7,100,946,582	7,142,419,816	8,561	8,611
第69計算期間末日	(2019年 8月 8日)	6,978,752,010	7,020,037,114	8,452	8,502
第70計算期間末日	(2019年 9月 9日)	7,038,152,129	7,079,220,900	8,569	8,619
第71計算期間末日	(2019年10月 8日)	6,986,898,914	7,027,795,236	8,542	8,592
第72計算期間末日	(2019年11月 8日)	6,873,121,206	6,897,190,648	8,567	8,597
第73計算期間末日	(2019年12月 9日)	6,690,674,356	6,714,199,702	8,532	8,562
第74計算期間末日	(2020年 1月 8日)	6,601,534,185	6,624,744,737	8,533	8,563
第75計算期間末日	(2020年 2月10日)	6,617,766,317	6,640,541,349	8,717	8,747
第76計算期間末日	(2020年 3月 9日)	6,480,231,484	6,502,843,908	8,597	8,627
第77計算期間末日	(2020年 4月 8日)	6,364,766,621	6,386,940,356	8,611	8,641
第78計算期間末日	(2020年 5月 8日)	6,275,449,480	6,297,571,448	8,510	8,540
第79計算期間末日	(2020年 6月 8日)	6,422,675,130	6,444,655,885	8,766	8,796
第80計算期間末日	(2020年 7月 8日)	6,306,013,567	6,327,757,927	8,700	8,730
第81計算期間末日	(2020年 8月11日)	6,230,558,850	6,252,198,066	8,638	8,668
第82計算期間末日	(2020年 9月 8日)	6,165,134,127	6,186,631,293	8,604	8,634
第83計算期間末日	(2020年10月 8日)	6,028,402,861	6,049,629,146	8,520	8,550

第84計算期間末日	(2020年11月 9日)	5,836,863,610	5,847,396,861	8,312	8,327
第85計算期間末日	(2020年12月 8日)	5,769,678,230	5,779,998,282	8,386	8,401
第86計算期間末日	(2021年 1月 8日)	5,652,427,173	5,662,599,912	8,335	8,350
第87計算期間末日	(2021年 2月 8日)	5,593,752,934	5,603,709,186	8,427	8,442
第88計算期間末日	(2021年 3月 8日)	5,499,458,213	5,509,205,573	8,463	8,478
第89計算期間末日	(2021年 4月 8日)	5,479,950,818	5,489,572,489	8,543	8,558
第90計算期間末日	(2021年 5月10日)	5,393,304,534	5,402,819,437	8,502	8,517
第91計算期間末日	(2021年 6月 8日)	5,293,822,241	5,303,099,311	8,560	8,575
第92計算期間末日	(2021年 7月 8日)	5,307,601,279	5,316,708,016	8,742	8,757
第93計算期間末日	(2021年 8月10日)	5,230,984,922	5,240,013,290	8,691	8,706
第94計算期間末日	(2021年 9月 8日)	5,150,758,518	5,159,676,371	8,664	8,679
第95計算期間末日	(2021年10月 8日)	5,061,142,891	5,069,889,049	8,680	8,695
第96計算期間末日	(2021年11月 8日)	5,007,738,829	5,016,217,053	8,860	8,875
第97計算期間末日	(2021年12月 8日)	4,877,072,745	4,885,395,593	8,790	8,805
第98計算期間末日	(2022年 1月11日)	4,847,718,535	4,855,961,648	8,821	8,836
第99計算期間末日	(2022年 2月 8日)	4,694,693,201	4,702,856,367	8,627	8,642
第100計算期間末日	(2022年 3月 8日)	4,655,588,013	4,663,743,211	8,563	8,578
第101計算期間末日	(2022年 4月 8日)	4,723,604,622	4,731,653,198	8,803	8,818
第102計算期間末日	(2022年 5月 9日)	4,708,795,671	4,716,723,931	8,909	8,924
第103計算期間末日	(2022年 6月 8日)	4,791,869,592	4,799,760,428	9,109	9,124
第104計算期間末日	(2022年 7月 8日)	4,783,614,256	4,791,464,495	9,140	9,155
第105計算期間末日	(2022年 8月 8日)	4,779,435,698	4,787,237,486	9,189	9,204
第106計算期間末日	(2022年 9月 8日)	4,974,433,737	4,982,220,004	9,583	9,598
第107計算期間末日	(2022年10月11日)	4,702,288,323	4,709,968,399	9,184	9,199
第108計算期間末日	(2022年11月 8日)	4,582,916,933	4,590,508,639	9,055	9,070
第109計算期間末日	(2022年12月 8日)	4,495,748,149	4,503,267,368	8,969	8,984
第110計算期間末日	(2023年 1月10日)	4,334,354,802	4,341,853,684	8,670	8,685
第111計算期間末日	(2023年 2月 8日)	4,239,177,285	4,246,533,918	8,644	8,659
第112計算期間末日	(2023年 3月 8日)	4,303,486,615	4,310,824,541	8,797	8,812
第113計算期間末日	(2023年 4月10日)	4,278,128,851	4,285,451,189	8,764	8,779
第114計算期間末日	(2023年 5月 8日)	4,356,163,554	4,363,413,560	9,013	9,028
第115計算期間末日	(2023年 6月 8日)	4,342,514,769	4,349,705,299	9,059	9,074
第116計算期間末日	(2023年 7月10日)	4,297,261,169	4,304,347,559	9,096	9,111
第117計算期間末日	(2023年 8月 8日)	4,278,704,996	4,285,711,970	9,160	9,175
第118計算期間末日	(2023年 9月 8日)	4,376,599,064	4,383,601,327	9,375	9,390
第119計算期間末日	(2023年10月10日)	4,263,898,664	4,270,840,359	9,214	9,229
第120計算期間末日	(2023年11月 8日)	4,318,820,637	4,325,679,429	9,445	9,460
第121計算期間末日	(2023年12月 8日)	4,178,234,655	4,184,934,992	9,354	9,369
第122計算期間末日	(2024年 1月 9日)	4,229,288,829	4,235,991,859	9,464	9,479
第123計算期間末日	(2024年 2月 8日)	4,261,636,918	4,268,219,422	9,711	9,726
第124計算期間末日	(2024年 3月 8日)	4,258,317,013	4,264,863,089	9,758	9,773
第125計算期間末日	(2024年 4月 8日)	4,284,637,590	4,291,148,267	9,871	9,886

第126計算期間末日	(2024年 5月 8日)	4,325,617,481	4,332,073,915	10,050	10,065
第127計算期間末日	(2024年 6月10日)	4,391,865,645	4,398,301,398	10,236	10,251
第128計算期間末日	(2024年 7月 8日)	4,543,036,325	4,549,459,408	10,609	10,624
第129計算期間末日	(2024年 8月 8日)	4,168,098,333	4,174,416,895	9,895	9,910
第130計算期間末日	(2024年 9月 9日)	4,064,987,733	4,071,265,704	9,713	9,728
2023年 9月末日		4,330,899,176	—	9,356	—
10月末日		4,180,666,149	—	9,149	—
11月末日		4,297,938,923	—	9,478	—
12月末日		4,190,138,914	—	9,372	—
2024年 1月末日		4,298,956,560	—	9,758	—
2月末日		4,285,429,379	—	9,828	—
3月末日		4,311,195,021	—	9,955	—
4月末日		4,345,453,079	—	10,096	—
5月末日		4,373,546,978	—	10,167	—
6月末日		4,524,464,435	—	10,566	—
7月末日		4,348,983,292	—	10,296	—
8月末日		4,133,687,965	—	9,853	—
9月末日		4,050,265,300	—	9,790	—

②【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第11計算期間	30円
第12計算期間	30円
第13計算期間	30円
第14計算期間	30円
第15計算期間	30円
第16計算期間	30円
第17計算期間	30円
第18計算期間	30円
第19計算期間	30円
第20計算期間	30円
第21計算期間	30円
第22計算期間	30円
第23計算期間	30円
第24計算期間	70円
第25計算期間	70円
第26計算期間	70円
第27計算期間	70円
第28計算期間	70円
第29計算期間	70円
第30計算期間	70円
第31計算期間	70円

第32計算期間	70円
第33計算期間	70円
第34計算期間	70円
第35計算期間	70円
第36計算期間	70円
第37計算期間	70円
第38計算期間	70円
第39計算期間	70円
第40計算期間	70円
第41計算期間	70円
第42計算期間	70円
第43計算期間	70円
第44計算期間	70円
第45計算期間	70円
第46計算期間	70円
第47計算期間	70円
第48計算期間	70円
第49計算期間	70円
第50計算期間	70円
第51計算期間	70円
第52計算期間	70円
第53計算期間	70円
第54計算期間	70円
第55計算期間	70円
第56計算期間	70円
第57計算期間	70円
第58計算期間	70円
第59計算期間	70円
第60計算期間	50円
第61計算期間	50円
第62計算期間	50円
第63計算期間	50円
第64計算期間	50円
第65計算期間	50円
第66計算期間	50円
第67計算期間	50円
第68計算期間	50円
第69計算期間	50円
第70計算期間	50円
第71計算期間	50円
第72計算期間	30円
第73計算期間	30円

第74計算期間	30円
第75計算期間	30円
第76計算期間	30円
第77計算期間	30円
第78計算期間	30円
第79計算期間	30円
第80計算期間	30円
第81計算期間	30円
第82計算期間	30円
第83計算期間	30円
第84計算期間	15円
第85計算期間	15円
第86計算期間	15円
第87計算期間	15円
第88計算期間	15円
第89計算期間	15円
第90計算期間	15円
第91計算期間	15円
第92計算期間	15円
第93計算期間	15円
第94計算期間	15円
第95計算期間	15円
第96計算期間	15円
第97計算期間	15円
第98計算期間	15円
第99計算期間	15円
第100計算期間	15円
第101計算期間	15円
第102計算期間	15円
第103計算期間	15円
第104計算期間	15円
第105計算期間	15円
第106計算期間	15円
第107計算期間	15円
第108計算期間	15円
第109計算期間	15円
第110計算期間	15円
第111計算期間	15円
第112計算期間	15円
第113計算期間	15円
第114計算期間	15円
第115計算期間	15円

第116計算期間	15円
第117計算期間	15円
第118計算期間	15円
第119計算期間	15円
第120計算期間	15円
第121計算期間	15円
第122計算期間	15円
第123計算期間	15円
第124計算期間	15円
第125計算期間	15円
第126計算期間	15円
第127計算期間	15円
第128計算期間	15円
第129計算期間	15円
第130計算期間	15円

③【収益率の推移】

	収益率（％）
第11計算期間	3.24
第12計算期間	6.47
第13計算期間	5.84
第14計算期間	△0.82
第15計算期間	0.32
第16計算期間	0.93
第17計算期間	0.70
第18計算期間	△2.39
第19計算期間	4.42
第20計算期間	△2.22
第21計算期間	2.12
第22計算期間	△4.81
第23計算期間	1.10
第24計算期間	1.88
第25計算期間	0.49
第26計算期間	△4.40
第27計算期間	△0.55
第28計算期間	△3.13
第29計算期間	△3.22
第30計算期間	△1.13
第31計算期間	1.03
第32計算期間	△4.51
第33計算期間	0.91
第34計算期間	0.30

第35計算期間	0.79
第36計算期間	1.26
第37計算期間	6.18
第38計算期間	2.90
第39計算期間	△2.95
第40計算期間	0.94
第41計算期間	△2.02
第42計算期間	1.58
第43計算期間	△1.57
第44計算期間	3.79
第45計算期間	△1.66
第46計算期間	△1.01
第47計算期間	3.12
第48計算期間	1.39
第49計算期間	△1.59
第50計算期間	0.49
第51計算期間	△4.98
第52計算期間	△3.40
第53計算期間	1.60
第54計算期間	0.93
第55計算期間	0.76
第56計算期間	0.99
第57計算期間	0.62
第58計算期間	△0.72
第59計算期間	1.44
第60計算期間	△0.29
第61計算期間	0.47
第62計算期間	△3.04
第63計算期間	2.56
第64計算期間	1.61
第65計算期間	1.22
第66計算期間	△0.60
第67計算期間	△0.52
第68計算期間	0.79
第69計算期間	△0.68
第70計算期間	1.97
第71計算期間	0.26
第72計算期間	0.64
第73計算期間	△0.05
第74計算期間	0.36
第75計算期間	2.50
第76計算期間	△1.03

第77計算期間	0.51
第78計算期間	△0.82
第79計算期間	3.36
第80計算期間	△0.41
第81計算期間	△0.36
第82計算期間	△0.04
第83計算期間	△0.62
第84計算期間	△2.26
第85計算期間	1.07
第86計算期間	△0.42
第87計算期間	1.28
第88計算期間	0.60
第89計算期間	1.12
第90計算期間	△0.30
第91計算期間	0.85
第92計算期間	2.30
第93計算期間	△0.41
第94計算期間	△0.13
第95計算期間	0.35
第96計算期間	2.24
第97計算期間	△0.62
第98計算期間	0.52
第99計算期間	△2.02
第100計算期間	△0.56
第101計算期間	2.97
第102計算期間	1.37
第103計算期間	2.41
第104計算期間	0.50
第105計算期間	0.70
第106計算期間	4.45
第107計算期間	△4.00
第108計算期間	△1.24
第109計算期間	△0.78
第110計算期間	△3.16
第111計算期間	△0.12
第112計算期間	1.94
第113計算期間	△0.20
第114計算期間	3.01
第115計算期間	0.67
第116計算期間	0.57
第117計算期間	0.86
第118計算期間	2.51

第119計算期間	△1.55
第120計算期間	2.66
第121計算期間	△0.80
第122計算期間	1.33
第123計算期間	2.76
第124計算期間	0.63
第125計算期間	1.31
第126計算期間	1.96
第127計算期間	2.00
第128計算期間	3.79
第129計算期間	△6.58
第130計算期間	△1.68

（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11計算期間	283,026,941	327,312,989	3,329,032,599
第12計算期間	187,098,061	245,373,625	3,270,757,035
第13計算期間	155,122,702	440,172,103	2,985,707,634
第14計算期間	199,594,272	228,611,845	2,956,690,061
第15計算期間	125,680,969	187,535,051	2,894,835,979
第16計算期間	170,086,378	125,459,864	2,939,462,493
第17計算期間	134,556,701	326,151,357	2,747,867,837
第18計算期間	279,982,612	90,799,213	2,937,051,236
第19計算期間	127,205,371	155,244,250	2,909,012,357
第20計算期間	225,678,222	119,068,592	3,015,621,987
第21計算期間	303,687,627	80,228,925	3,239,080,689
第22計算期間	416,271,026	99,314,214	3,556,037,501
第23計算期間	162,209,226	54,053,116	3,664,193,611
第24計算期間	64,257,236	66,837,312	3,661,613,535
第25計算期間	1,028,822,222	74,583,954	4,615,851,803
第26計算期間	1,172,691,898	103,578,677	5,684,965,024
第27計算期間	850,966,208	77,148,496	6,458,782,736
第28計算期間	930,779,739	40,595,401	7,348,967,074
第29計算期間	1,261,480,939	69,712,422	8,540,735,591
第30計算期間	570,505,532	59,810,963	9,051,430,160
第31計算期間	777,562,462	83,475,502	9,745,517,120
第32計算期間	624,983,776	220,376,615	10,150,124,281
第33計算期間	294,678,765	166,555,085	10,278,247,961
第34計算期間	854,553,726	189,601,133	10,943,200,554
第35計算期間	1,105,373,156	203,774,710	11,844,799,000
第36計算期間	851,602,353	229,575,839	12,466,825,514

第37計算期間	767,050,769	1,522,118,298	11,711,757,985
第38計算期間	550,271,638	1,146,433,475	11,115,596,148
第39計算期間	330,514,647	719,757,293	10,726,353,502
第40計算期間	342,140,184	385,804,070	10,682,689,616
第41計算期間	540,618,679	742,028,291	10,481,280,004
第42計算期間	310,242,016	169,166,286	10,622,355,734
第43計算期間	321,048,871	387,027,528	10,556,377,077
第44計算期間	194,631,379	544,599,244	10,206,409,212
第45計算期間	127,703,365	455,375,701	9,878,736,876
第46計算期間	254,976,092	161,588,164	9,972,124,804
第47計算期間	200,167,663	395,625,742	9,776,666,725
第48計算期間	192,654,796	329,853,474	9,639,468,047
第49計算期間	118,358,626	314,687,698	9,443,138,975
第50計算期間	89,001,237	242,140,508	9,289,999,704
第51計算期間	41,564,674	107,234,527	9,224,329,851
第52計算期間	33,535,488	146,644,835	9,111,220,504
第53計算期間	33,924,477	125,689,986	9,019,454,995
第54計算期間	23,909,058	91,403,399	8,951,960,654
第55計算期間	39,130,246	61,030,379	8,930,060,521
第56計算期間	57,053,305	97,309,689	8,889,804,137
第57計算期間	55,226,887	124,197,904	8,820,833,120
第58計算期間	117,352,263	103,112,856	8,835,072,527
第59計算期間	45,076,539	58,459,319	8,821,689,747
第60計算期間	23,569,698	83,448,091	8,761,811,354
第61計算期間	17,897,612	80,272,541	8,699,436,425
第62計算期間	24,862,939	112,665,391	8,611,633,973
第63計算期間	30,882,683	85,800,186	8,556,716,470
第64計算期間	20,570,840	72,716,020	8,504,571,290
第65計算期間	17,956,812	61,622,700	8,460,905,402
第66計算期間	13,202,717	123,627,154	8,350,480,965
第67計算期間	16,671,091	47,101,914	8,320,050,142
第68計算期間	28,577,403	53,980,720	8,294,646,825
第69計算期間	41,416,588	79,042,524	8,257,020,889
第70計算期間	25,663,879	68,930,484	8,213,754,284
第71計算期間	14,492,662	48,982,474	8,179,264,472
第72計算期間	20,220,348	176,337,270	8,023,147,550
第73計算期間	8,139,102	189,504,460	7,841,782,192
第74計算期間	10,591,658	115,523,117	7,736,850,733
第75計算期間	6,200,185	151,373,508	7,591,677,410
第76計算期間	55,518,866	109,721,326	7,537,474,950
第77計算期間	4,802,567	151,032,457	7,391,245,060
第78計算期間	5,381,091	22,636,699	7,373,989,452

第79計算期間	7,275,978	54,346,836	7,326,918,594
第80計算期間	7,245,954	86,044,491	7,248,120,057
第81計算期間	5,805,448	40,853,376	7,213,072,129
第82計算期間	21,461,624	68,811,682	7,165,722,071
第83計算期間	5,276,477	95,570,107	7,075,428,441
第84計算期間	5,104,384	58,365,262	7,022,167,563
第85計算期間	3,247,380	145,379,800	6,880,035,143
第86計算期間	3,627,106	101,836,093	6,781,826,156
第87計算期間	5,690,112	150,014,339	6,637,501,929
第88計算期間	2,910,535	142,171,912	6,498,240,552
第89計算期間	2,063,746	85,856,887	6,414,447,411
第90計算期間	2,671,476	73,849,881	6,343,269,006
第91計算期間	1,993,549	160,549,056	6,184,713,499
第92計算期間	1,808,382	115,363,625	6,071,158,256
第93計算期間	1,779,206	54,025,008	6,018,912,454
第94計算期間	2,439,585	76,116,109	5,945,235,930
第95計算期間	1,837,080	116,300,353	5,830,772,657
第96計算期間	2,979,322	181,602,472	5,652,149,507
第97計算期間	3,370,573	106,954,605	5,548,565,475
第98計算期間	1,823,092	54,979,476	5,495,409,091
第99計算期間	4,726,454	58,024,804	5,442,110,741
第100計算期間	24,520,492	29,832,294	5,436,798,939
第101計算期間	5,081,256	76,162,761	5,365,717,434
第102計算期間	3,895,942	84,106,572	5,285,506,804
第103計算期間	4,439,112	29,388,543	5,260,557,373
第104計算期間	6,499,542	33,563,933	5,233,492,982
第105計算期間	13,399,168	45,699,573	5,201,192,577
第106計算期間	24,230,794	34,578,049	5,190,845,322
第107計算期間	12,852,220	83,646,617	5,120,050,925
第108計算期間	3,300,899	62,214,278	5,061,137,546
第109計算期間	14,048,279	62,372,621	5,012,813,204
第110計算期間	7,116,412	20,674,657	4,999,254,959
第111計算期間	13,274,434	108,106,981	4,904,422,412
第112計算期間	25,271,838	37,743,046	4,891,951,204
第113計算期間	21,272,350	31,664,468	4,881,559,086
第114計算期間	7,174,364	55,395,498	4,833,337,952
第115計算期間	12,603,685	52,254,643	4,793,686,994
第116計算期間	40,233,487	109,660,171	4,724,260,310
第117計算期間	15,368,662	68,312,641	4,671,316,331
第118計算期間	23,865,309	27,005,679	4,668,175,961
第119計算期間	5,883,013	46,261,790	4,627,797,184
第120計算期間	13,470,766	68,739,455	4,572,528,495

第121計算期間	11,986,701	117,623,198	4,466,891,998
第122計算期間	33,193,614	31,398,620	4,468,686,992
第123計算期間	2,028,684	82,379,160	4,388,336,516
第124計算期間	12,796,691	37,081,909	4,364,051,298
第125計算期間	14,304,359	37,903,984	4,340,451,673
第126計算期間	22,915,892	59,078,182	4,304,289,383
第127計算期間	5,263,085	19,050,175	4,290,502,293
第128計算期間	2,148,018	10,594,595	4,282,055,716
第129計算期間	3,003,917	72,684,506	4,212,375,127
第130計算期間	1,460,503	28,521,152	4,185,314,478

（参考）

マネー・マーケット・マザーファンド

投資状況

2024年 9月30日現在
（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	5,486,801,669	100.00
純資産総額		5,486,801,669	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》

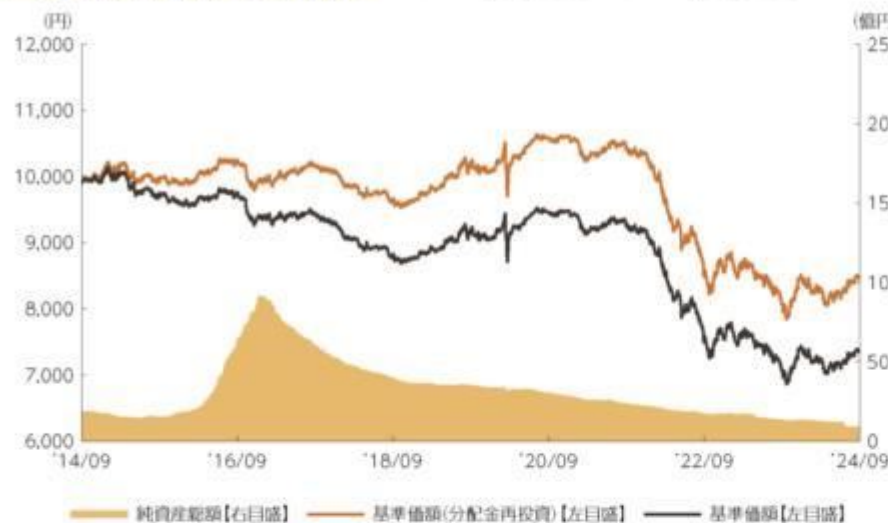


運用実績

2024年9月30日現在

<米ドルヘッジ型> (毎月決算型)

■基準価額・純資産の推移 2014年9月30日～2024年9月30日



- ・基準価額(分配金再投資)はグラフの起点における基準価額に合わせて指数化
- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	7,359円
純資産総額	8.9億円

・純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2024年9月	5円
2024年8月	5円
2024年7月	5円
2024年6月	5円
2024年5月	5円
2024年4月	5円

直近1年間累計 60円

設定来累計 1,455円

・分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

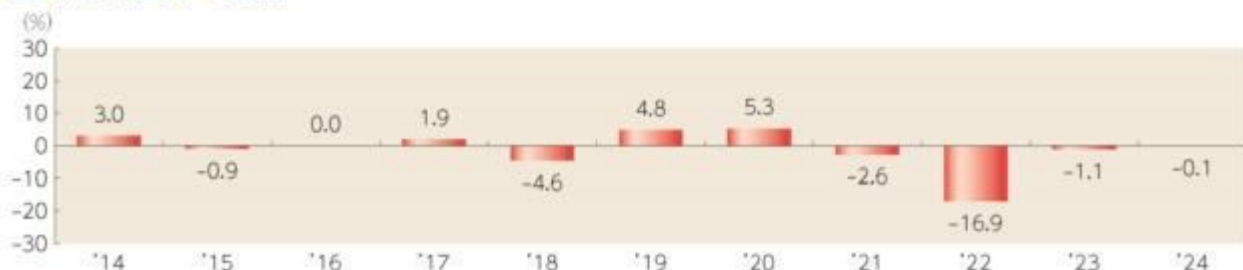
資産構成	比率
ビムコ・ータル・リターン・ファンドII - クラスJ (JPY, Hedged)	99.1%
マネー・マーケット・マザーファンド	0.2%
コールローン他 (負債控除後)	0.7%
合計	100.0%

- ・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)
- ・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。

組入上位銘柄	クーポン	償還日	比率
1 FNMA TBA 5.5% NOV 30YR	5.5000%	2054/11/14	11.7%
2 FNMA TBA 5.0% NOV 30YR	5.0000%	2054/11/14	9.7%
3 FNMA TBA 4.0% NOV 30YR	4.0000%	2054/11/14	8.1%
4 FNMA TBA 6.0% NOV 30YR	6.0000%	2054/11/14	5.2%
5 FNMA TBA 4.5% NOV 30YR	4.5000%	2054/11/14	4.9%
6 FNMA TBA 3.5% NOV 30YR	3.5000%	2054/11/14	3.8%
7 U S TREASURY BOND	3.3750%	2044/05/15	3.1%
8 U S TREASURY BOND	3.8750%	2043/05/15	2.1%
9 FNMA TBA 3.0% OCT 30YR	3.0000%	2054/10/15	2.0%
10 FNMA PASS THRU 30YR #RA6992	3.0000%	2052/03/01	1.5%

- ・比率は実質的な投資を行う投資信託証券の純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

■年間収益率の推移

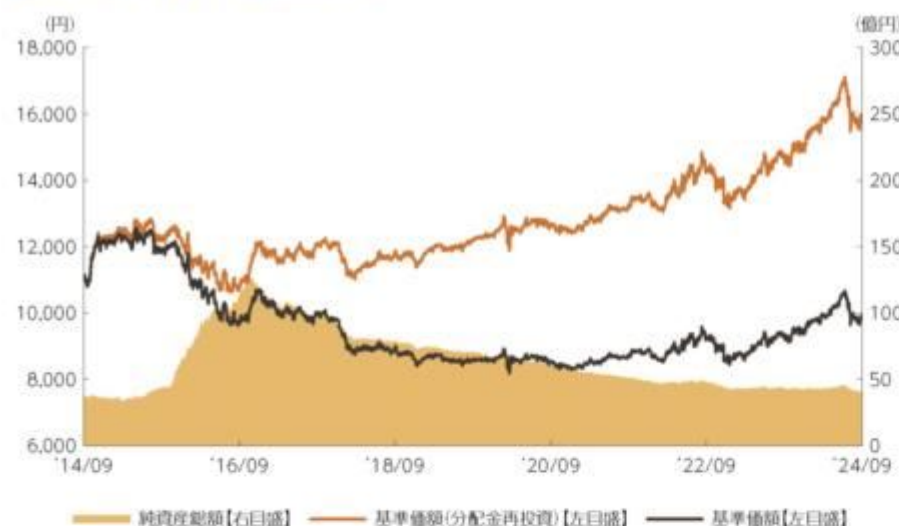


- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2024年は年初から9月30日までの収益率を表示
- ・ファンドにベンチマークはありません。

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

＜為替ヘッジなし＞（毎月決算型）

■基準価額・純資産の推移 2014年9月30日～2024年9月30日



- ・基準価額(分配金再投資)はグラフの起点における基準価額に合わせて指数化
- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	9,790円
純資産総額	40.5億円

・純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2024年9月	15円
2024年8月	15円
2024年7月	15円
2024年6月	15円
2024年5月	15円
2024年4月	15円
直近1年間累計	180円
設定来累計	4,815円

・分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

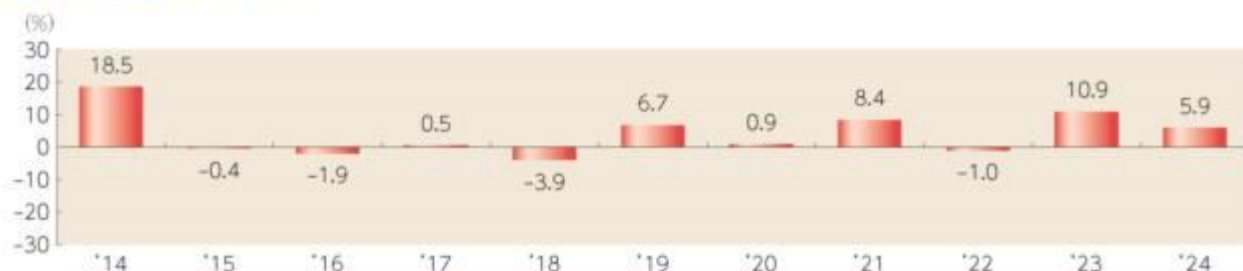
資産構成	比率
ビムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ(JPY)	99.4%
マネー・マーケット・マザーファンド	0.1%
コールローン他 (負債控除後)	0.5%
合計	100.0%

- ・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)
- ・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。

組入上位銘柄	クーポン	償還日	比率
1 FNMA TBA 5.5% NOV 30YR	5.5000%	2054/11/14	11.7%
2 FNMA TBA 5.0% NOV 30YR	5.0000%	2054/11/14	9.7%
3 FNMA TBA 4.0% NOV 30YR	4.0000%	2054/11/14	8.1%
4 FNMA TBA 6.0% NOV 30YR	6.0000%	2054/11/14	5.2%
5 FNMA TBA 4.5% NOV 30YR	4.5000%	2054/11/14	4.9%
6 FNMA TBA 3.5% NOV 30YR	3.5000%	2054/11/14	3.8%
7 U S TREASURY BOND	3.3750%	2044/05/15	3.1%
8 U S TREASURY BOND	3.8750%	2043/05/15	2.1%
9 FNMA TBA 3.0% OCT 30YR	3.0000%	2054/10/15	2.0%
10 FNMA PASS THRU 30YR #RA6992	3.0000%	2052/03/01	1.5%

- ・比率は実質的な投資を行う投資信託証券の純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

■年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2024年は年初から9月30日までの収益率を表示
- ・ファンドにベンチマークはありません。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

①申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。
ただし、以下の日は申込みができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日
ニューヨークの銀行の休業日
ルクセンブルクの銀行の休業日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

②申込単位

販売会社が定める単位

③申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

④申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑤申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。
また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ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/>

⑥申込手数料

申込価額（発行価格）×2.2%（税抜 2%）を上限として販売会社が定める手数料率

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、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

⑦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、申込金額および申込手数料（税込）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。

⑧申込受付時間

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後3時30分までに、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。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に取得申込みを締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

⑨取得申込みの受付の中止および取消し

金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象証券の取得の制限、投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことがあります。

※申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

①解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ルクセンブルグの銀行の休業日

受益者の解約請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

②解約単位

販売会社が定める単位

③解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

④信託財産留保額

ありません。

⑤解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑥解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ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/>

⑦支払開始日

解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。

⑧解約請求受付時間

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時30分までに、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。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に解約請求を締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

⑨解約請求受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象証券の換金の制限、投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求を取り消すことがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとしします。

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

①基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口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。

②基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

③基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ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/>

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

2028年９月８日まで（2013年10月25日設定）

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

（４）【計算期間】

毎月９日から翌月８日まで

ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

①ファンドの償還条件等

委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。（任意償還）

- ・各ファンドについて、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合
- ・各ファンドについて、「三菱ＵＦＪ／ピムコ トータル・リターン・ファンド＜米ドルヘッジ型＞（毎月決算型）」、「三菱ＵＦＪ／ピムコ トータル・リターン・ファンド＜為替ヘッジなし＞（毎月決算型）」、「三菱ＵＦＪ／ピムコ トータル・リターン・ファンド＜米ドルヘッジ型＞（年１回決算型）」、「三菱ＵＦＪ／ピムコ トータル・リターン・ファンド＜為替ヘッジなし＞（年１回決算型）」の受益権の口数を合計した口数が30億口を下回ることとなった場合
- ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき

このほか、投資対象とする外国投資信託がその信託を終了することとなる場合、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。

委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。

②信託約款の変更等

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

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。

③ファンドの償還等に関する開示方法

委託会社は、ファンドの任意償還（信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたとき、また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、書面決議の手続を行うことが困難な場合を除きます。）、信託約款の変更または併合（変更にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合

にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款変更等」といいます。）をしようとする場合には、書面による決議（「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに任意償還等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、受益者に対し書面をもって書面決議の通知を発します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、受益者が議決権を行使しないときは書面決議について賛成するものとみなします。書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上をもって行います。書面決議の効力は、ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

併合に係るいずれかのファンドにおいて、書面決議が否決された場合、併合を行うことはできません。

④ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

⑤ 関係法人との契約の更改

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

委託会社と再委託先との間で締結された契約の期間は、原則として、ファンドの信託期間終了日までとします。

⑥ 運用報告書

委託会社は、毎年3月および9月に終了する計算期間の末日および償還時に、交付運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更、ファンドの任意償還等があった場合は、その内容を交付運用報告書に記載します。

⑦ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

⑧ 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

⑨ 信託事務の再信託

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

⑩ 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.am.mufg.jp/>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の

公告は、日本経済新聞に掲載します。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

（1）収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

①分配金受取コース（一般コース）

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

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

②分配金再投資コース（累積投資コース）

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

（2）償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

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

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

（3）換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

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

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 毎月決算ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- 3 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（2024年 3月9日から2024年 9月 9日まで）の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三菱UFJ／ピムコ トータル・リターン・ファンド＜米ドルヘッジ型＞（毎月決算型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 [2024年 3月 8日現在]	当期 [2024年 9月 9日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	20,414,469	6,279,823
投資信託受益証券	1,273,632,918	889,801,725
親投資信託受益証券	1,438,432	1,438,997
未収利息	-	36
流動資産合計	1,295,485,819	897,520,581
資産合計	1,295,485,819	897,520,581
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	883,235	609,108
未払解約金	7,628,042	100,037
未払受託者報酬	33,727	25,805
未払委託者報酬	1,540,188	1,178,449
未払利息	6	-
その他未払費用	3,363	2,567
流動負債合計	10,088,561	1,915,966
負債合計	10,088,561	1,915,966
純資産の部		
元本等		
元本	1,766,471,688	1,218,217,606
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△481,074,430	△322,612,991
（分配準備積立金）	20,188,882	10,253,583
元本等合計	1,285,397,258	895,604,615
純資産合計	1,285,397,258	895,604,615
負債純資産合計	1,295,485,819	897,520,581

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自 2023年 9月 9日 至 2024年 3月 8日	当期 自 2024年 3月 9日 至 2024年 9月 9日
営業収益		
受取利息	41	5,372
有価証券売買等損益	21,577,412	18,269,372
営業収益合計	21,577,453	18,274,744
営業費用		
支払利息	958	24
受託者報酬	215,496	189,224
委託者報酬	9,840,753	8,641,226
その他費用	21,487	18,860
営業費用合計	10,078,694	8,849,334
営業利益又は営業損失（△）	11,498,759	9,425,410
経常利益又は経常損失（△）	11,498,759	9,425,410
当期純利益又は当期純損失（△）	11,498,759	9,425,410
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△12,625	1,461,440
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△526,403,711	△481,074,430
剰余金増加額又は欠損金減少額	42,100,720	155,788,750
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	42,100,720	155,788,750
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,836,388	666,329
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,836,388	666,329
分配金	5,446,435	4,624,952
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△481,074,430	△322,612,991

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの特定期間 当ファンドは、原則として毎年3月8日および9月8日を特定期間の末日としておりますが、当特定期間においては当該日が休業日のため、当特定期間は2024年 3月 9日から2024年 9月 9日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	前期 [2024年 3月 8日現在]	当期 [2024年 9月 9日現在]
1. 期首元本額	1,902,370,576円	1,766,471,688円
期中追加設定元本額	10,330,599円	2,352,634円
期中一部解約元本額	146,229,487円	550,606,716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。	481,074,430円	322,612,991円
3. 受益権の総数	1,766,471,688口	1,218,217,606口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2023年 9月 9日 至 2024年 3月 8日			当期 自 2024年 3月 9日 至 2024年 9月 9日																																																														
1.運用に係る権限を委託するための費用 信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の49以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。			1.運用に係る権限を委託するための費用 信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の49以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。																																																														
2.分配金の計算過程 第119期 2023年 9月 9日 2023年10月10日			2.分配金の計算過程 第125期 2024年 3月 9日 2024年 4月 8日																																																														
<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>－円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>－円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>39,696,909円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>27,414,121円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>67,111,030円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>1,890,887,399口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>354円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>5円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>945,443円</td></tr></table>			項目			費用控除後の配当等収益額	A	－円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	収益調整金額	C	39,696,909円	分配準備積立金額	D	27,414,121円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	67,111,030円	当ファンドの期末残存口数	F	1,890,887,399口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	354円	1万口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	945,443円	<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>－円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>－円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>37,033,508円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>20,087,465円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>57,120,973円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>1,758,011,692口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>324円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>5円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>879,005円</td></tr></table>			項目			費用控除後の配当等収益額	A	－円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	収益調整金額	C	37,033,508円	分配準備積立金額	D	20,087,465円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	57,120,973円	当ファンドの期末残存口数	F	1,758,011,692口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	324円	1万口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	879,005円
項目																																																																	
費用控除後の配当等収益額	A	－円																																																															
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円																																																															
収益調整金額	C	39,696,909円																																																															
分配準備積立金額	D	27,414,121円																																																															
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	67,111,030円																																																															
当ファンドの期末残存口数	F	1,890,887,399口																																																															
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	354円																																																															
1万口当たり分配金額	H	5円																																																															
収益分配金金額	I=F*H/10,000	945,443円																																																															
項目																																																																	
費用控除後の配当等収益額	A	－円																																																															
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円																																																															
収益調整金額	C	37,033,508円																																																															
分配準備積立金額	D	20,087,465円																																																															
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	57,120,973円																																																															
当ファンドの期末残存口数	F	1,758,011,692口																																																															
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	324円																																																															
1万口当たり分配金額	H	5円																																																															
収益分配金金額	I=F*H/10,000	879,005円																																																															
第120期 2023年10月11日 2023年11月 8日			第126期 2024年 4月 9日 2024年 5月 8日																																																														
<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>－円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>－円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>38,355,337円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>25,563,249円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>63,918,586円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>1,826,672,835口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>349円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>5円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>913,336円</td></tr></table>			項目			費用控除後の配当等収益額	A	－円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	収益調整金額	C	38,355,337円	分配準備積立金額	D	25,563,249円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	63,918,586円	当ファンドの期末残存口数	F	1,826,672,835口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	349円	1万口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	913,336円	<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>－円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>－円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>35,967,597円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>18,639,712円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>54,607,309円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>1,706,915,404口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>319円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>5円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>853,457円</td></tr></table>			項目			費用控除後の配当等収益額	A	－円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	収益調整金額	C	35,967,597円	分配準備積立金額	D	18,639,712円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	54,607,309円	当ファンドの期末残存口数	F	1,706,915,404口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	319円	1万口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	853,457円
項目																																																																	
費用控除後の配当等収益額	A	－円																																																															
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円																																																															
収益調整金額	C	38,355,337円																																																															
分配準備積立金額	D	25,563,249円																																																															
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	63,918,586円																																																															
当ファンドの期末残存口数	F	1,826,672,835口																																																															
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	349円																																																															
1万口当たり分配金額	H	5円																																																															
収益分配金金額	I=F*H/10,000	913,336円																																																															
項目																																																																	
費用控除後の配当等収益額	A	－円																																																															
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円																																																															
収益調整金額	C	35,967,597円																																																															
分配準備積立金額	D	18,639,712円																																																															
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	54,607,309円																																																															
当ファンドの期末残存口数	F	1,706,915,404口																																																															
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	319円																																																															
1万口当たり分配金額	H	5円																																																															
収益分配金金額	I=F*H/10,000	853,457円																																																															
第121期 2023年11月 9日 2023年12月 8日			第127期 2024年 5月 9日 2024年 6月10日																																																														
<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>－円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>－円</td></tr></table>			項目			費用控除後の配当等収益額	A	－円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>4円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>－円</td></tr></table>			項目			費用控除後の配当等収益額	A	4円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円																																										
項目																																																																	
費用控除後の配当等収益額	A	－円																																																															
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円																																																															
項目																																																																	
費用控除後の配当等収益額	A	4円																																																															
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円																																																															

前期 自 2023年 9月 9日 至 2024年 3月 8日			当期 自 2024年 3月 9日 至 2024年 9月 9日		
収益調整金額	C	38,066,164円	収益調整金額	C	35,455,665円
分配準備積立金額	D	24,452,923円	分配準備積立金額	D	17,529,308円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	62,519,087円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	52,984,977円
当ファンドの期末残存口数	F	1,812,577,528口	当ファンドの期末残存口数	F	1,682,499,961口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	344円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	314円
1万口当たり分配金額	H	5円	1万口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	906,288円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	841,249円
第122期 2023年12月 9日 2024年 1月 9日			第128期 2024年 6月11日 2024年 7月 8日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	－円	費用控除後の配当等収益額	A	501円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	37,851,737円	収益調整金額	C	34,909,815円
分配準備積立金額	D	23,388,522円	分配準備積立金額	D	16,427,831円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	61,240,259円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	51,338,147円
当ファンドの期末残存口数	F	1,801,618,026口	当ファンドの期末残存口数	F	1,656,491,477口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	339円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	309円
1万口当たり分配金額	H	5円	1万口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	900,809円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	828,245円
第123期 2024年 1月10日 2024年 2月 8日			第129期 2024年 7月 9日 2024年 8月 8日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	－円	費用控除後の配当等収益額	A	1,889円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	37,793,066円	収益調整金額	C	25,876,454円
分配準備積立金額	D	22,312,941円	分配準備積立金額	D	11,560,450円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	60,106,007円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	37,438,793円
当ファンドの期末残存口数	F	1,794,648,145口	当ファンドの期末残存口数	F	1,227,776,784口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	334円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	304円
1万口当たり分配金額	H	5円	1万口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	897,324円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	613,888円
第124期 2024年 2月 9日 2024年 3月 8日			第130期 2024年 8月 9日 2024年 9月 9日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	－円	費用控除後の配当等収益額	A	1,337円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	37,206,983円	収益調整金額	C	25,676,842円
分配準備積立金額	D	21,072,117円	分配準備積立金額	D	10,861,354円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	58,279,100円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	36,539,533円
当ファンドの期末残存口数	F	1,766,471,688口	当ファンドの期末残存口数	F	1,218,217,606口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	329円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	299円
1万口当たり分配金額	H	5円	1万口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	883,235円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	609,108円

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	前期 自 2023年 9月 9日 至 2024年 3月 8日	当期 自 2024年 3月 9日 至 2024年 9月 9日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左

区分	前期 自 2023年 9月 9日 至 2024年 3月 8日	当期 自 2024年 3月 9日 至 2024年 9月 9日
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。 当ファンドは、ファンドの運用の指図に関する権限を再委託しております。この場合、再委託先で投資リスクに対する管理体制を構築しているほか、当該再委託先のリスクの管理体制や管理状況の確認を委託会社で行っております。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	前期 [2024年 3月 8日現在]	当期 [2024年 9月 9日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	前期 [2024年 3月 8日現在]	当期 [2024年 9月 9日現在]
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
投資信託受益証券	1,345,801	12,411,028
親投資信託受益証券	—	282
合計	1,345,801	12,411,310

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	前期 [2024年 3月 8日現在]	当期 [2024年 9月 9日現在]
1口当たり純資産額	0.7277円	0.7352円
(1万口当たり純資産額)	(7,277円)	(7,352円)

（４）【附属明細表】**第１ 有価証券明細表****（１）株式**

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	ピムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ（JPY, Hedged）	114,916.92	889,801,725	
投資信託受益証券 合計		114,916.92	889,801,725	
親投資信託受益証券	マネー・マーケット・マザーファンド	1,412,860	1,438,997	
親投資信託受益証券 合計		1,412,860	1,438,997	
合計		1,527,776.92	891,240,722	

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三菱UFJ／ピムコ トータル・リターン・ファンド＜為替ヘッジなし＞（毎月決算型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 [2024年 3月 8日現在]	当期 [2024年 9月 9日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	41,609,090	20,702,747
投資信託受益証券	4,224,174,837	4,024,396,690
親投資信託受益証券	5,509,774	5,511,939
未収入金	-	33,600,000
未収利息	-	120
流動資産合計	4,271,293,701	4,084,211,496
資産合計	4,271,293,701	4,084,211,496
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	6,546,076	6,277,971
未払解約金	1,199,934	7,335,582
未払受託者報酬	111,846	119,961
未払委託者報酬	5,107,644	5,478,263
未払利息	12	-
その他未払費用	11,176	11,986
流動負債合計	12,976,688	19,223,763
負債合計	12,976,688	19,223,763
純資産の部		
元本等		
元本	4,364,051,298	4,185,314,478
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△105,734,285	△120,326,745
（分配準備積立金）	178,229,966	508,442,276
元本等合計	4,258,317,013	4,064,987,733
純資産合計	4,258,317,013	4,064,987,733
負債純資産合計	4,271,293,701	4,084,211,496

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自 2023年 9月 9日 至 2024年 3月 8日	当期 自 2024年 3月 9日 至 2024年 9月 9日
営業収益		
受取配当金	108,599,818	105,557,666
受取利息	138	15,351
有価証券売買等損益	135,725,482	△45,433,648
営業収益合計	244,325,438	60,139,369
営業費用		
支払利息	3,239	74
受託者報酬	701,863	722,812
委託者報酬	32,051,805	33,008,470
その他費用	70,125	72,222
営業費用合計	32,827,032	33,803,578
営業利益又は営業損失（△）	211,498,406	26,335,791
経常利益又は経常損失（△）	211,498,406	26,335,791
当期純利益又は当期純損失（△）	211,498,406	26,335,791
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	3,209,568	△408,493
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△291,576,897	△105,734,285
剰余金増加額又は欠損金減少額	22,332,724	2,271,865
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	22,332,724	1,977,658
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	294,207
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,446,516	5,186,129
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	4,774,671
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,446,516	411,458
分配金	40,332,434	38,422,480
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△105,734,285	△120,326,745

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの特定期間 当ファンドは、原則として毎年3月8日および9月8日を特定期間の末日としておりますが、当特定期間においては当該日が休業日のため、当特定期間は2024年 3月 9日から2024年 9月 9日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	前期 [2024年 3月 8日現在]	当期 [2024年 9月 9日現在]
1. 期首元本額	4,668,175,961円	4,364,051,298円
期中追加設定元本額	79,359,469円	49,095,774円
期中一部解約元本額	383,484,132円	227,832,594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。	105,734,285円	120,326,745円
3. 受益権の総数	4,364,051,298口	4,185,314,478口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2023年 9月 9日 至 2024年 3月 8日	当期 自 2024年 3月 9日 至 2024年 9月 9日																																																												
1.運用に係る権限を委託するための費用 信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の49以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	1.運用に係る権限を委託するための費用 信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の49以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。																																																												
2.分配金の計算過程 第119期 2023年 9月 9日 2023年10月10日	2.分配金の計算過程 第125期 2024年 3月 9日 2024年 4月 8日																																																												
<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>13,537,129円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>－円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>516,719,656円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>139,321,891円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>669,578,676円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>4,627,797,184口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>1,446円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>15円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>6,941,695円</td></tr></table> 第120期 2023年10月11日 2023年11月 8日	項目			費用控除後の配当等収益額	A	13,537,129円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	収益調整金額	C	516,719,656円	分配準備積立金額	D	139,321,891円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	669,578,676円	当ファンドの期末残存口数	F	4,627,797,184口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,446円	1万口当たり分配金額	H	15円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,941,695円	<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>16,009,112円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>14,085,371円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>487,808,656円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>176,682,377円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>694,585,516円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>4,340,451,673口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>1,600円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>15円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>6,510,677円</td></tr></table> 第126期 2024年 4月 9日 2024年 5月 8日	項目			費用控除後の配当等収益額	A	16,009,112円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	14,085,371円	収益調整金額	C	487,808,656円	分配準備積立金額	D	176,682,377円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	694,585,516円	当ファンドの期末残存口数	F	4,340,451,673口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,600円	1万口当たり分配金額	H	15円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,510,677円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	13,537,129円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円																																																											
収益調整金額	C	516,719,656円																																																											
分配準備積立金額	D	139,321,891円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	669,578,676円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	4,627,797,184口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,446円																																																											
1万口当たり分配金額	H	15円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,941,695円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	16,009,112円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	14,085,371円																																																											
収益調整金額	C	487,808,656円																																																											
分配準備積立金額	D	176,682,377円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	694,585,516円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	4,340,451,673口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,600円																																																											
1万口当たり分配金額	H	15円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,510,677円																																																											
<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>18,670,447円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>－円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>510,971,948円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>143,751,474円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>673,393,869円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>4,572,528,495口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>1,472円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>15円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>6,858,792円</td></tr></table> 第121期 2023年11月 9日 2023年12月 8日	項目			費用控除後の配当等収益額	A	18,670,447円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	収益調整金額	C	510,971,948円	分配準備積立金額	D	143,751,474円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	673,393,869円	当ファンドの期末残存口数	F	4,572,528,495口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,472円	1万口当たり分配金額	H	15円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,858,792円	<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>17,048,950円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>65,973,939円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>484,826,090円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>197,545,954円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>765,394,933円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>4,304,289,383口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>1,778円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>15円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>6,456,434円</td></tr></table> 第127期 2024年 5月 9日 2024年 6月10日	項目			費用控除後の配当等収益額	A	17,048,950円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	65,973,939円	収益調整金額	C	484,826,090円	分配準備積立金額	D	197,545,954円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	765,394,933円	当ファンドの期末残存口数	F	4,304,289,383口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,778円	1万口当たり分配金額	H	15円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,456,434円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	18,670,447円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円																																																											
収益調整金額	C	510,971,948円																																																											
分配準備積立金額	D	143,751,474円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	673,393,869円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	4,572,528,495口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,472円																																																											
1万口当たり分配金額	H	15円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,858,792円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	17,048,950円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	65,973,939円																																																											
収益調整金額	C	484,826,090円																																																											
分配準備積立金額	D	197,545,954円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	765,394,933円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	4,304,289,383口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,778円																																																											
1万口当たり分配金額	H	15円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,456,434円																																																											
<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>13,361,936円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>－円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	13,361,936円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>17,362,381円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>69,145,544円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	17,362,381円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	69,145,544円																																										
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	13,361,936円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	17,362,381円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	69,145,544円																																																											

前期 自 2023年 9月 9日 至 2024年 3月 8日			当期 自 2024年 3月 9日 至 2024年 9月 9日		
収益調整金額	C	499,600,567円	収益調整金額	C	483,607,005円
分配準備積立金額	D	151,567,834円	分配準備積立金額	D	272,900,497円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	664,530,337円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	843,015,427円
当ファンドの期末残存口数	F	4,466,891,998口	当ファンドの期末残存口数	F	4,290,502,293口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,487円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,964円
1万口当たり分配金額	H	15円	1万口当たり分配金額	H	15円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,700,337円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,435,753円
第122期 2023年12月 9日 2024年 1月 9日			第128期 2024年 6月11日 2024年 7月 8日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	15,056,767円	費用控除後の配当等収益額	A	17,930,724円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	148,289,741円
収益調整金額	C	500,972,492円	収益調整金額	C	482,831,607円
分配準備積立金額	D	157,122,022円	分配準備積立金額	D	352,101,334円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	673,151,281円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,001,153,406円
当ファンドの期末残存口数	F	4,468,686,992口	当ファンドの期末残存口数	F	4,282,055,716口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,506円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,337円
1万口当たり分配金額	H	15円	1万口当たり分配金額	H	15円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,703,030円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,423,083円
第123期 2024年 1月10日 2024年 2月 8日			第129期 2024年 7月 9日 2024年 8月 8日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	15,924,726円	費用控除後の配当等収益額	A	11,811,571円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	492,038,793円	収益調整金額	C	475,328,572円
分配準備積立金額	D	162,426,276円	分配準備積立金額	D	503,214,869円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	670,389,795円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	990,355,012円
当ファンドの期末残存口数	F	4,388,336,516口	当ファンドの期末残存口数	F	4,212,375,127口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,527円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,351円
1万口当たり分配金額	H	15円	1万口当たり分配金額	H	15円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,582,504円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,318,562円
第124期 2024年 2月 9日 2024年 3月 8日			第130期 2024年 8月 9日 2024年 9月 9日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	14,458,501円	費用控除後の配当等収益額	A	9,455,574円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	489,844,310円	収益調整金額	C	472,450,476円
分配準備積立金額	D	170,317,541円	分配準備積立金額	D	505,264,673円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	674,620,352円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	987,170,723円
当ファンドの期末残存口数	F	4,364,051,298口	当ファンドの期末残存口数	F	4,185,314,478口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,545円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,358円
1万口当たり分配金額	H	15円	1万口当たり分配金額	H	15円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,546,076円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,277,971円

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	前期 自 2023年 9月 9日 至 2024年 3月 8日	当期 自 2024年 3月 9日 至 2024年 9月 9日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左

区分	前期 自 2023年 9月 9日 至 2024年 3月 8日	当期 自 2024年 3月 9日 至 2024年 9月 9日
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。 当ファンドは、ファンドの運用の指図に関する権限を再委託しております。この場合、再委託先で投資リスクに対する管理体制を構築しているほか、当該再委託先のリスクの管理体制や管理状況の確認を委託会社で行っております。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	前期 [2024年 3月 8日現在]	当期 [2024年 9月 9日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	前期 [2024年 3月 8日現在]	当期 [2024年 9月 9日現在]
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
投資信託受益証券	14,668,789	△79,189,290
親投資信託受益証券	—	1,082
合計	14,668,789	△79,188,208

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	前期 [2024年 3月 8日現在]	当期 [2024年 9月 9日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9758円 (9,758円)	0.9713円 (9,713円)

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	ピムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ（J P Y）	349,097.56	4,024,396,690	
投資信託受益証券 合計		349,097.56	4,024,396,690	
親投資信託受益証券	マネー・マーケット・マザーファンド	5,411,821	5,511,939	
親投資信託受益証券 合計		5,411,821	5,511,939	
合計		5,760,918.56	4,029,908,629	

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

マネー・マーケット・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年 9月 9日現在]	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	912,743,083
現先取引勘定	3,599,930,960
未収利息	5,331
流動資産合計	4,512,679,374
資産合計	4,512,679,374
負債の部	
流動負債	
未払解約金	71,102
流動負債合計	71,102
負債合計	71,102
純資産の部	
元本等	
元本	4,430,673,509
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	81,934,763
元本等合計	4,512,608,272
純資産合計	4,512,608,272
負債純資産合計	4,512,679,374

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。

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

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 9月 9日現在]
1. 期首	2024年 3月 9日
期首元本額	3,665,205,800円
期中追加設定元本額	916,195,290円
期中一部解約元本額	150,727,581円
元本の内訳※	
三菱ＵＦＪ ＤＣ金利連動アロケーション型バランスファンド	1,029,437,390円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (毎月分配型)	2,210,674円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (毎月分配型)	2,590,474円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (毎月分配型)	9,893,887円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (毎月分配型)	24,765,135円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	40,112,985円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド (毎月分配型)	6,895,341円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド (毎月分配型)	907,086円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース> (毎月分配型)	5,548,198円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルリアルコース> (毎月分配型)	74,308円
三菱ＵＦＪ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (毎月分配型)	2,531,128円
三菱ＵＦＪ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (毎月分配型)	1,339,040円
三菱ＵＦＪ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (毎月分配型)	742,450円
三菱ＵＦＪ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (毎月分配型)	10,743,284円
三菱ＵＦＪ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース> (毎月分配型)	629,892円
三菱ＵＦＪ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<アジアバスケット通貨コース> (毎月分配型)	416,840円
三菱ＵＦＪ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	1,330,522円
三菱ＵＦＪ 欧州ハイイールド債券ファンド ユーロ円プレミアム (毎月分配型)	7,489,236円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジあり)	2,515,903円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジなし)	4,289,171円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース> (毎月分配型)	4,489,124円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド (年2回分配型)	30,651円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド (年2回分配型)	60,179円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース> (年2回分配型)	20,650円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルリアルコース> (年2回分配型)	20,635円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース> (年2回分配型)	278,281円
三菱ＵＦＪ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型)	665,580円
三菱ＵＦＪ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	726,876円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型)	2,119,621円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	44,142円
バリュー・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (毎月決算型)	9,822円
バリュー・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	9,829円

	[2024年 9月 9日現在]
バリュー・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型>(年1回決算型)	9,829円
バリュー・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし>(年1回決算型)	9,829円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	2,007,890円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	4,789,826円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	1,491,640円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンドA>	20,067,227円
三菱UFJ/ピムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型>(毎月決算型)	1,412,860円
三菱UFJ/ピムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	5,411,821円
三菱UFJ/ピムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型>(年1回決算型)	1,020,693円
三菱UFJ/ピムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし>(年1回決算型)	2,065,331円
ピムコ・エマージング・ボンド・オープン Cコース(為替ヘッジなし)(年1回決算型)	521,457円
ピムコ・エマージング・ボンド・オープン Dコース(為替ヘッジあり)(年1回決算型)	217,015円
米国バンクロンファンド<為替ヘッジあり>(毎月分配型)	960,981円
米国バンクロンファンド<為替ヘッジなし>(毎月分配型)	3,700,833円
米国バンクロン・オープン<為替ヘッジあり>(毎月決算型)	98,223円
米国バンクロン・オープン<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	98,222円
米国バンクロン・オープン<為替ヘッジあり>(年1回決算型)	98,222円
米国バンクロン・オープン<為替ヘッジなし>(年1回決算型)	98,222円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム>(毎月分配型)	5,541,524円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム>(年2回分配型)	1,739,541円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム>(毎月分配型)	18,468,833円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム>(年2回分配型)	3,319,056円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース>(毎月分配型)	13,122,469円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース>(年2回分配型)	1,616,484円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 米ドル円プレミアム(毎月分配型)	2,724,520円
三菱UFJ Jリート不動産株ファンド<米ドル投資型>(3ヵ月決算型)	98,222円
三菱UFJ Jリート不動産株ファンド<Wプレミアム>(毎月決算型)	98,222円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	2,562,701,858円
マクロ・トータル・リターン・ファンド	9,820円
米国バンクロンファンド<為替ヘッジあり>(資産成長型)	89,287円
米国バンクロンファンド<為替ヘッジなし>(資産成長型)	138,420円
テンブルトン新興国小型株ファンド	49,097円
ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<限定為替ヘッジあり>(毎月決算型)	2,966,566円
ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<限定為替ヘッジあり>(年2回決算型)	6,675,966円
ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	29,562,692円
ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし>(年2回決算型)	21,860,284円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	135,595,898円
欧州ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジあり)(年1回決算型)	169,198円
欧州ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジなし)(年1回決算型)	87,384円
わたしの未来設計<安定重視型>(分配コース)	9,820円
わたしの未来設計<安定重視型>(分配抑制コース)	9,820円
わたしの未来設計<成長重視型>(分配コース)	9,820円

	[2024年 9月 9日現在]
わたしの未来設計＜成長重視型＞（分配抑制コース）	9,820円
ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド	9,821円
グローバル・インカム・フルコース（為替リスク軽減型）	983円
グローバル・インカム・フルコース（為替ヘッジなし）	983円
<DC>ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド	9,821円
ベイリー・ギフォード インパクト投資ファンド	9,821円
<DC>ベイリー・ギフォード ESG世界株ファンド	9,822円
ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド（予想分配金提示型）	9,822円
ベイリー・ギフォード インパクト投資ファンド（予想分配金提示型）	9,822円
米国株式トレンド・ウォッチ戦略ファンド	983円
三菱ＵＦＪ インド債券オープン（毎月決算型）	39,351円
三菱ＵＦＪ／マッコーリー オーストラリアREITファンド＜Wプレミアム＞（毎月決算型）	97,104円
マネープールファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）	279,190,950円
ピムコ・グローバル・ハイイールド・ファンド（毎月分配型）	11,784,347円
ピムコ・エマージング・ボンド・オープン Aコース（為替ヘッジなし）	6,887,212円
ピムコ・エマージング・ボンド・オープン Bコース（為替ヘッジあり）	5,484,593円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤーファンド 2030	11,883,831円
三菱ＵＦＪ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2030	101,551,167円
合計	4,430,673,509円
2. 受益権の総数	4,430,673,509口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2024年 3月 9日 至 2024年 9月 9日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年 9月 9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。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[2024年 9月 9日現在]
1口当たり純資産額	1.0185円
(1万口当たり純資産額)	(10,185円)

附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

２【ファンドの現況】

【三菱ＵＦＪ／ピムコ トータル・リターン・ファンド＜米ドルヘッジ型＞（毎月決算型）】

【純資産額計算書】

2024年 9月30日現在

(単位：円)

I 資産総額	895,171,370
II 負債総額	795,406
III 純資産総額（I－II）	894,375,964
IV 発行済口数	1,215,280,378口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	0.7359
（10,000口当たり）	（7,359）

【三菱ＵＦＪ／ピムコ トータル・リターン・ファンド＜為替ヘッジなし＞（毎月決算型）】

【純資産額計算書】

2024年 9月30日現在

(単位：円)

I 資産総額	4,054,207,131
II 負債総額	3,941,831
III 純資産総額（I－II）	4,050,265,300
IV 発行済口数	4,137,304,043口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	0.9790
（10,000口当たり）	（9,790）

(参考)

マネー・マーケット・マザーファンド

純資産額計算書

2024年 9月30日現在

(単位：円)

I 資産総額	5,486,882,999
II 負債総額	81,330
III 純資産総額（I－II）	5,486,801,669
IV 発行済口数	5,386,560,971口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	1.0186
（10,000口当たり）	（10,186）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、委託会社は、この信託の受益権を取扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取

消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

（２）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

該当事項はありません。

（４）受益権の譲渡

- ①受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ②上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- ③上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（５）受益権の譲渡の対抗要件

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（1）資本金の額等

2024年9月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間ににおける資本金の額の増減はありません。

（2）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

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

・投資運用の意思決定機構

①投資環境見通しの策定

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

②運用戦略の決定

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

③運用計画の決定

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

④ポートフォリオの構築

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

⑤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。

⑥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。

⑦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。

⑧運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年 9月30日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本 数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	823	36,526,770
追加型公社債投資信託	16	1,490,103
単位型株式投資信託	87	387,500
単位型公社債投資信託	45	102,963
合 計	971	38,507,336

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

3【委託会社等の経理状況】

（1）財務諸表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。

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

（2）監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第39期事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：千円）

第38期 (2023年3月31日現在)			第39期 (2024年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	※2	51,733,041	※2	58,206,340
有価証券		1,579,691		15,283
前払費用		770,747		679,199
未収入金		81,854		138,388
未収委託者報酬		16,753,855		21,064,747
未収収益	※2	688,142	※2	1,485,701
金銭の信託		10,400,000		10,500,500

その他		745,576		371,400
流動資産合計		82,752,908		92,461,561
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	181,551	※1	2,936,036
器具備品	※1	730,357	※1	1,531,857
土地		628,433		628,433
建設仮勘定		1,111,177		45,140
有形固定資産合計		2,651,520		5,141,467
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		4,183,644		5,008,987
ソフトウェア仮勘定		1,907,739		1,587,548
無形固定資産合計		6,107,206		6,612,357
投資その他の資産				
投資有価証券		12,022,365		13,788,071
関係会社株式		159,536		159,536
投資不動産	※1	807,066	※1	1,788,120
長期差入保証金		689,492		689,867
前払年金費用		118,832		47,573
繰延税金資産		1,675,132		1,088,836
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		15,494,056		17,583,636
固定資産合計		24,252,782		29,337,461
資産合計		107,005,691		121,799,022

(単位：千円)

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	507,559	807,451
未払金		
未払収益分配金	114,094	105,550
未払償還金	7,418	43,553
未払手数料	※2 6,139,595	※2 7,523,485
その他未払金	※2 955,697	※2 885,002
未払費用	※2 5,778,896	※2 8,611,140
未払消費税等	439,657	623,219
未払法人税等	2,375,281	2,235,007
賞与引当金	849,840	1,182,242
役員賞与引当金	154,872	175,992
その他	5,517	12,303
流動負債合計	17,328,431	22,204,949
固定負債		
退職給付引当金	1,333,882	1,608,101
役員退職慰労引当金	75,667	30,105
時効後支払損引当金	254,296	250,350

資産除去債務	-	1,428,586
その他	-	29,109
固定負債合計	1,663,846	3,346,253
負債合計	18,992,277	25,551,202
(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	33,267,700	40,236,787
利益剰余金合計	40,608,289	47,577,377
株主資本合計	87,341,133	94,310,221

(単位：千円)

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024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	672,279	1,937,598
評価・換算差額等合計	672,279	1,937,598
純資産合計	88,013,413	96,247,820
負債純資産合計	107,005,691	121,799,022

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	84,121,445	98,635,342
投資顧問料	2,750,601	3,117,320
その他営業収益	10,412	148,442
営業収益合計	86,882,459	101,901,104
営業費用		
支払手数料	※4 31,461,274	※4 34,494,219
広告宣伝費	798,894	593,586
公告費	375	1,017
調査費		
調査費	2,849,042	3,537,103
委託調査費	19,236,505	27,296,058
事務委託費	1,751,807	1,861,577
営業雑経費		

通信費	113,480	137,737
印刷費	367,379	390,143
協会費	58,128	68,869
諸会費	18,447	20,108
事務機器関連費	2,238,382	2,531,009
その他営業雑経費	-	139,012
営業費用合計	58,893,717	71,070,444
一般管理費		
給料		
役員報酬	416,461	400,592
給料・手当	6,565,766	7,202,711
賞与引当金繰入	849,840	1,182,242
役員賞与引当金繰入	154,872	175,992
福利厚生費	1,279,885	1,424,215
交際費	8,942	10,054
旅費交通費	75,274	108,782
租税公課	403,955	397,138
不動産賃借料	719,707	728,550
退職給付費用	388,176	381,449
固定資産減価償却費	2,418,341	2,469,755
諸経費	444,313	490,104
一般管理費合計	13,725,534	14,971,590
営業利益	14,263,207	15,859,070

(単位：千円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	47,353	54,618
受取利息	※4 10,279	※4 12,836
投資有価証券償還益	609,102	204,527
収益分配金等時効完成分	94,351	17,722
受取賃貸料	※4 65,808	※4 162,111
その他	36,894	44,734
営業外収益合計	863,788	496,550
営業外費用		
投資有価証券償還損	32,995	234,700
時効後支払損引当金繰入	31,951	-
事務過誤費	2,680	10,822
賃貸関連費用	14,262	108,773
その他	32,394	25,903
営業外費用合計	114,284	380,199
経常利益	15,012,711	15,975,421
特別利益		
投資有価証券売却益	387,113	464,927
固定資産売却益	-	※1 16,229
資産除去債務履行差額	-	87,050
特別利益合計	387,113	568,207

特別損失

投資有価証券売却損		15,828		57,011
投資有価証券評価損		104,554		31,651
固定資産除却損	※3	32,791	※3	20,246
固定資産売却損		-	※2	65,427
減損損失	※5	315,350		-
企業結合関連費用		-	※6	1,187,136
特別損失合計		468,524		1,361,473
税引前当期純利益		14,931,300		15,182,154
法人税、住民税及び事業税	※4	4,860,444	※4	4,542,085
法人税等調整額		△271,471		102,468
法人税等合計		4,588,973		4,644,553
当期純利益		10,342,327		10,537,601

(3) 【株主資本等変動計算書】

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

	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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				
企業結合による増加				
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	33,267,700	40,608,289	87,341,133
当期変動額					
企業結合による増加			1,602,526	1,602,526	1,602,526
剰余金の配当			△5,171,039	△5,171,039	△5,171,039
当期純利益			10,537,601	10,537,601	10,537,601
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)					
当期変動額合計	—	—	6,969,087	6,969,087	6,969,087
当期末残高	342,589	6,998,000	40,236,787	47,577,377	94,310,221

	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

当期変動額			
企業結合による増加			1,602,526
剰余金の配当			△5,171,039
当期純利益			10,537,601
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	1,265,319	1,265,319	1,265,319
当期変動額合計	1,265,319	1,265,319	8,234,406
当期末残高	1,937,598	1,937,598	96,247,820

[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	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. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4) 退職給付引当金

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

① 退職給付見込額の期間帰属方法

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

②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5)役員退職慰労引当金

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

(6)時効後支払損引当金

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

6.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。

(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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
建物	1,006,606千円	498,805千円
器具備品	1,985,072千円	1,643,689千円
投資不動産	163,978千円	211,090千円

※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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
預金	40,165,058千円	39,776,992千円
未収収益	15,046千円	12,312千円
未払手数料	790,279千円	886,173千円
その他未払金	77,007千円	105,407千円
未払費用	277,358千円	599,493千円

(損益計算書関係)

※1.固定資産売却益の内訳

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
器具備品	-	16,229千円
計	-	16,229千円

※2.固定資産売却損の内訳

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
器具備品	-	65,427千円
計	-	65,427千円

※3.固定資産除却損の内訳

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
建物	1,047千円	15,825千円
器具備品	29,762千円	3,986千円
ソフトウェア	1,981千円	434千円
計	32,791千円	20,246千円

※4.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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
支払手数料	4,893,312千円	5,006,309千円
受取利息	10,236千円	12,747千円
受取賃貸料	68,168千円	152,876千円
法人税、住民税及び事業税	3,947,200千円	132,303千円

※5.減損損失

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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つのグルーピングとしております。

ホームページのリニューアルに伴い、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。

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

当事業年度については、該当事項はありません。

※6.企業結合関連費用

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

前事業年度については、該当事項はありません。

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

企業結合に伴うものであり、主にシステム統合費用などであります。

（株主資本等変動計算書関係）

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。

①	配当金の総額	6,075,125千円
②	1株当たり配当額	28,713円
③	基準日	2022年3月31日
④	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において、次のとおり決議しております。

①	配当金の総額	5,171,039千円
②	配当の原資	利益剰余金
③	1株当たり配当額	24,440円
④	基準日	2023年3月31日
⑤	効力発生日	2023年6月29日

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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

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。

①	配当金の総額	5,171,039千円
②	1株当たり配当額	24,440円
③	基準日	2023年3月31日
④	効力発生日	2023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

2024年6月26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。

①	配当金の総額	45,747,620千円
②	配当の原資	利益剰余金
③	1株当たり配当額	216,218円
④	基準日	2024年3月31日
⑤	効力発生日	2024年6月27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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
1年内	962,809千円	681,212千円
1年超	1,532,728千円	851,515千円
合計	2,495,537千円	1,532,728千円

（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（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	—

第39期(2024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	15,283	15,283	—
(2) 金銭の信託	10,500,500	10,500,500	—
(3) 投資有価証券	13,788,071	13,788,071	—
資産計	24,303,855	24,303,855	—

(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39期(2024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	58,206,340	—	—	—
金銭の信託	10,500,500	—	—	—
未収委託者報酬	21,064,747	—	—	—
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	15,283	5,351,373	347,505	11,696
合計	89,786,871	5,351,373	347,505	11,696

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。

第39期(2024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	—	15,283	—	15,283
金銭の信託	—	10,500,500	—	10,500,500
投資有価証券	2,014,968	11,773,103	—	13,788,071

資産計	2,014,968	22,288,887	—	24,303,855
-----	-----------	------------	---	------------

(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38期（2023年3月31日現在）及び第39期（2024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。

第39期(2024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	17,364,277	14,269,984	3,094,293
	小計	17,364,277	14,269,984	3,094,293
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	6,939,577	7,241,136	△301,559
	小計	6,939,577	7,241,136	△301,559
合計		24,303,855	21,511,121	2,792,733

(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10,500,500千円、取得原価は10,500,000千円）を含めております。

3. 売却したその他有価証券

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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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	3,750,272	464,927	57,011
合計	3,750,272	464,927	57,011

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。

当事業年度において、有価証券について31,651千円（その他有価証券のその他31,651千円）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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,723,521 千円	3,582,778 千円
勤務費用	196,190	182,947
利息費用	25,925	39,626
数理計算上の差異の発生額	△186,130	△79,379
退職給付の支払額	△176,727	△300,286
過去勤務費用の発生額	—	—
企業結合による影響額	—	226,499
退職給付債務の期末残高	3,582,778	3,652,185

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
年金資産の期首残高	2,583,927 千円	2,425,752 千円
期待運用収益	46,453	43,626
数理計算上の差異の発生額	△103,934	227,699
事業主からの拠出額	—	—
退職給付の支払額	△100,694	△204,536
年金資産の期末残高	2,425,752	2,492,542

(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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
積立型制度の 退職給付債務	2,468,195 千円	2,250,427 千円
年金資産	△2,425,752	△2,492,542
	42,442	△242,114
非積立型制度の退職給付債務	1,114,583	1,401,758
未積立退職給付債務	1,157,025	1,159,643
未認識数理計算上の差異	281,343	558,841
未認識過去勤務費用	△223,319	△157,957
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,215,049	1,560,527
退職給付引当金	1,333,882	1,608,101
前払年金費用	△118,832	△47,573
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,215,049	1,560,527

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	196,190 千円	182,947 千円
利息費用	25,925	39,626
期待運用収益	△46,453	△43,626
数理計算上の差異の 費用処理額	△6,532	△29,581
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
退職給付制度の統合に係る 調整額	-	34,505
その他	1,600	2,196
確定給付制度に係る 退職給付費用	236,091	251,429

(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。「退職給付制度の統合に係る調整額」は企業結合関連費用の一部として特別損失に計上しております。

(5)年金資産に関する事項

①年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
債券	63.6 %	62.0 %
株式	34.2	35.9
その他	2.2	2.1
合計	100	100

②長期期待運用収益率の設定方法

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

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
--	------------------------	------------------------

割引率	0.066～1.13%	1.39～1.41%
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152,084千円、当事業年度164,524千円であります。

（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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	499,742千円	389,750千円
投資有価証券評価損	47,876	30,021
未払事業税	169,997	126,161
賞与引当金	260,221	362,002
役員賞与引当金	29,828	33,564
役員退職慰労引当金	23,169	9,218
退職給付引当金	408,434	492,400
減価償却超過額	227,100	199,986
差入保証金	52,869	—
資産除去債務	—	16,900
時効後支払損引当金	77,865	76,657
その他	212,315	227,182
繰延税金資産 小計	2,009,420	1,963,847
評価性引当額	—	—
繰延税金資産 合計	2,009,420	1,963,847
繰延税金負債		
前払年金費用	△36,386	△14,567
その他有価証券評価差額金	△296,702	△855,135
その他	△1,199	△5,308
繰延税金負債 合計	△334,288	△875,010
繰延税金資産の純額	1,675,132	1,088,836

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38期（2023年3月31日現在）及び第39期（2024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、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。

（企業結合等関係）

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

(1)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

(2)企業結合日

2023年10月1日

(3)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

(4)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

(5)企業結合を行った主な理由

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.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いたしました。

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1.当該資産除去債務の概要

建物の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2.当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を取得から15年と見積り、割引率は1.1%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3.当該資産除去債務の総額の増減

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
期首残高	—	—
有形固定資産の取得に伴う増加	—	1,420,750千円
時の経過による調整額	—	7,835千円
期末残高	—	1,428,586千円

（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38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）及び第39期（自 2023年4月1日 至 2024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38期（自2022年4月1日 至 2023年3月31日）及び第39期（自 2023年4月1日 至 2024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	(株)三菱UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税等	連結納税等に 伴う支払 (注1)	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(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	4,893,312 千円	未払手数料	790,279 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 (注3)	463,416 千円	未払費用	253,093 千円

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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	(株)三菱UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	グループ通算制 度	グループ通算 制度に伴う通 算税効果額 (注4)	132,303 千円	その他未払金	105,407 千円
親	三菱UFJ 信託銀行(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,006,309 千円	未払手数料	886,173 千円

会社						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 (注3)	463,831 千円	未払費用	260,800 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。
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. グループ通算制度に基づく通算税効果額であります。
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	(株)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(株)	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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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	(株)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)	4,354,007 千円	未払手数料	1,028,586 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(株)	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)	7,493,449 千円	未払手数料	1,449,414 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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	415,979.76円	454,898.22円
1株当たり当期純利益金額	48,881.17円	49,804.10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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益金額（千円）	10,342,327	10,537,601
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）	10,342,327	10,537,601
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581	211,581

4 【利害関係人との取引制限】

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

- ① 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ② 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ③ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める

要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

- ④委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ⑤上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5【その他】

- ①定款の変更等
定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
- ②訴訟事件その他重要事項
該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（1）受託会社

- ①名称：三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社
（再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）
- ②資本金の額：324,279百万円（2024年3月末現在）
- ③事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

（2）販売会社

①名称	②資本金の額 (2024年3月末現在)	③事業の内容
株式会社三菱ＵＦＪ銀行	1,711,958 百万円	銀行業務を営んでいます。
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。
auカブコム証券株式会社	7,196 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
PWM日本証券株式会社	3,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社ＳＢＩ証券	54,323 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	19,495 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

（3）再委託先

- ①名称：ピムコジャパンリミテッド
- ②資本金の額：13,411,674.44米ドル（2024年3月末現在）
- ③事業の内容：投資運用業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

- （1）受託会社：ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。
- （2）販売会社：ファンドの募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。
- （3）再委託先：委託会社から投資信託証券への運用の指図に関する権限の委託を受け、ファンドにおける運用の指図を行います。

3【資本関係】

該当ありません。（2024年9月末現在）

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

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2024年 3月21日	臨時報告書
2024年 6月 7日	有価証券届出書の訂正届出書
2024年 6月 7日	有価証券報告書
2024年 6月20日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

2024年6月7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

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アセットマネジメント株式会社の2024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。

独立監査人の監査報告書

2024年11月13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 久保 直毅
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**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ／ピムコ トータル・リターン・ファンド＜米ドルヘッジ型＞（毎月決算型）の2024年3月9日から2024年9月9日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ／ピムコ トータル・リターン・ファンド＜米ドルヘッジ型＞（毎月決算型）の2024年9月9日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三菱UFJ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、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、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む）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。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

三菱ＵＦＪ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。

独立監査人の監査報告書

2024年11月13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 久保 直毅
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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ／ピムコ トータル・リターン・ファンド＜為替ヘッジなし＞（毎月決算型）の2024年3月9日から2024年9月9日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ／ピムコ トータル・リターン・ファンド＜為替ヘッジなし＞（毎月決算型）の2024年9月9日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三菱UFJ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、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、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む）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。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

三菱ＵＦＪ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。