

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年12月24日提出
【計算期間】	第12期中(自 2024年3月26日至 2024年9月25日)
【ファンド名】	三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型） 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型） 三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型） 三菱UFJアセットマネジメント株式会社
【発行者名】	取締役社長 横川 直
【代表者の役職氏名】	
【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。

1【ファンドの運用状況】

【三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）】

（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（％）
親投資信託受益証券	日本	15,252,796,186	96.26
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	592,018,346	3.74
純資産総額		15,844,814,532	100.00

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

（2）【運用実績】

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2計算期間末日（2015年 3月25日）	21,743,970,931	21,743,970,931	11,001	11,001
第3計算期間末日（2016年 3月25日）	52,322,002,817	52,322,002,817	10,915	10,915
第4計算期間末日（2017年 3月27日）	46,411,260,274	46,411,260,274	10,781	10,781
第5計算期間末日（2018年 3月26日）	27,872,022,932	27,872,022,932	11,124	11,124
第6計算期間末日（2019年 3月25日）	30,377,735,462	30,377,735,462	11,215	11,215
第7計算期間末日（2020年 3月25日）	28,457,787,754	28,457,787,754	11,015	11,015
第8計算期間末日（2021年 3月25日）	25,856,771,935	25,856,771,935	11,347	11,347
第9計算期間末日（2022年 3月25日）	21,812,432,808	21,812,432,808	11,322	11,322
第10計算期間末日（2023年 3月27日）	19,195,691,228	19,195,691,228	10,819	10,819
第11計算期間末日（2024年 3月25日）	17,469,607,404	17,469,607,404	11,645	11,645
2023年 9月末日	18,035,645,106	—	10,837	—
10月末日	17,429,041,801	—	10,616	—
11月末日	17,743,684,034	—	10,972	—
12月末日	17,537,917,723	—	11,089	—
2024年 1月末日	17,520,019,299	—	11,288	—
2月末日	17,503,546,130	—	11,495	—
3月末日	17,429,902,877	—	11,671	—
4月末日	16,962,887,680	—	11,579	—
5月末日	16,774,585,730	—	11,594	—
6月末日	16,839,436,415	—	11,802	—
7月末日	16,355,756,801	—	11,665	—
8月末日	15,917,947,225	—	11,406	—

9月末日	15,844,814,532	—	11,408	—
------	----------------	---	--------	---

②【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第2計算期間	0円
第3計算期間	0円
第4計算期間	0円
第5計算期間	0円
第6計算期間	0円
第7計算期間	0円
第8計算期間	0円
第9計算期間	0円
第10計算期間	0円
第11計算期間	0円

③【収益率の推移】

	収益率（％）
第2計算期間	8.19
第3計算期間	△0.78
第4計算期間	△1.22
第5計算期間	3.18
第6計算期間	0.81
第7計算期間	△1.78
第8計算期間	3.01
第9計算期間	△0.22
第10計算期間	△4.44
第11計算期間	7.63
第12中間計算期間	△1.88

（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。

【三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）】

（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（％）
親投資信託受益証券	日本	18,367,877,172	96.36
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	693,827,364	3.64
純資産総額		19,061,704,536	100.00

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

（２）【運用実績】

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2計算期間末日	(2015年 3月25日)	24,655,190,688	24,655,190,688	11,765	11,765
第3計算期間末日	(2016年 3月25日)	61,738,348,442	61,738,348,442	11,488	11,488
第4計算期間末日	(2017年 3月27日)	43,553,330,759	43,553,330,759	11,535	11,535
第5計算期間末日	(2018年 3月26日)	27,531,362,672	27,531,362,672	12,321	12,321
第6計算期間末日	(2019年 3月25日)	31,437,259,282	31,437,259,282	12,534	12,534
第7計算期間末日	(2020年 3月25日)	28,750,760,854	28,750,760,854	12,010	12,010
第8計算期間末日	(2021年 3月25日)	26,855,099,280	26,855,099,280	12,862	12,862
第9計算期間末日	(2022年 3月25日)	22,691,860,863	22,691,860,863	13,219	13,219
第10計算期間末日	(2023年 3月27日)	19,985,923,195	19,985,923,195	12,488	12,488
第11計算期間末日	(2024年 3月25日)	20,538,508,706	20,538,508,706	14,991	14,991
	2023年 9月末日	19,643,343,231	—	13,151	—
	10月末日	18,914,109,765	—	12,772	—
	11月末日	19,510,867,416	—	13,325	—
	12月末日	19,311,176,555	—	13,481	—
	2024年 1月末日	19,839,904,249	—	14,099	—
	2月末日	20,225,912,445	—	14,645	—
	3月末日	20,536,319,152	—	15,044	—
	4月末日	20,364,865,944	—	15,023	—
	5月末日	20,453,760,992	—	15,226	—
	6月末日	20,853,450,677	—	15,698	—
	7月末日	20,215,148,704	—	15,327	—
	8月末日	19,200,559,999	—	14,677	—
	9月末日	19,061,704,536	—	14,635	—

②【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第2計算期間	0円
第3計算期間	0円
第4計算期間	0円
第5計算期間	0円
第6計算期間	0円
第7計算期間	0円
第8計算期間	0円
第9計算期間	0円
第10計算期間	0円
第11計算期間	0円

③【収益率の推移】

	収益率（％）
第2計算期間	14.31
第3計算期間	△2.35
第4計算期間	0.40
第5計算期間	6.81
第6計算期間	1.72
第7計算期間	△4.18
第8計算期間	7.09
第9計算期間	2.77
第10計算期間	△5.52
第11計算期間	20.04
第12中間計算期間	△2.37

（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。

【三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）】

（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（％）
親投資信託受益証券	日本	3,935,352,813	97.88
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	85,333,385	2.12
純資産総額		4,020,686,198	100.00

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

（２）【運用実績】

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2計算期間末日	（2015年 3月25日）	1,066,640,671	1,066,640,671	10,816	10,816
第3計算期間末日	（2016年 3月25日）	1,296,388,956	1,296,388,956	10,811	10,811
第4計算期間末日	（2017年 3月27日）	1,185,983,561	1,185,983,561	11,276	11,276
第5計算期間末日	（2018年 3月26日）	8,838,464,673	8,838,464,673	12,488	12,488
第6計算期間末日	（2019年 3月25日）	9,471,549,757	9,471,549,757	12,185	12,185
第7計算期間末日	（2020年 3月25日）	8,417,184,461	8,417,184,461	11,099	11,099
第8計算期間末日	（2021年 3月25日）	7,842,260,783	7,842,260,783	12,768	12,768
第9計算期間末日	（2022年 3月25日）	5,200,930,166	5,200,930,166	12,033	12,033
第10計算期間末日	（2023年 3月27日）	4,350,134,203	4,350,134,203	11,131	11,131
第11計算期間末日	（2024年 3月25日）	4,514,210,743	4,514,210,743	13,118	13,118
2023年 9月末日		4,354,505,955	—	11,640	—

10月末日	4,229,235,786	—	11,391	—
11月末日	4,331,088,904	—	11,792	—
12月末日	4,340,248,573	—	12,033	—
2024年 1月末日	4,344,168,504	—	12,313	—
2月末日	4,463,763,620	—	12,795	—
3月末日	4,499,034,994	—	13,160	—
4月末日	4,485,822,199	—	13,337	—
5月末日	4,402,354,756	—	13,520	—
6月末日	4,451,788,837	—	13,977	—
7月末日	4,173,367,063	—	13,385	—
8月末日	4,013,765,841	—	12,904	—
9月末日	4,020,686,198	—	12,988	—

②【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第2計算期間	0円
第3計算期間	0円
第4計算期間	0円
第5計算期間	0円
第6計算期間	0円
第7計算期間	0円
第8計算期間	0円
第9計算期間	0円
第10計算期間	0円
第11計算期間	0円

③【収益率の推移】

	収益率（％）
第2計算期間	7.78
第3計算期間	△0.04
第4計算期間	4.30
第5計算期間	10.74
第6計算期間	△2.42
第7計算期間	△8.91
第8計算期間	15.03
第9計算期間	△5.75
第10計算期間	△7.49
第11計算期間	17.85
第12中間計算期間	△0.80

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

（参考）

TOPIXマザーファンド

投資状況

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（％）
株式	日本	1,476,908,429,160	98.38
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	－	24,279,792,618	1.62
純資産総額		1,501,188,221,778	100.00

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

その他の資産の投資状況

2024年 9月30日現在
(単位：円)

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	24,251,100,000	1.62

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

外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

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（％）
株式	アメリカ	4,541,226,733,942	72.52
	イギリス	239,257,216,589	3.82
	カナダ	197,650,120,750	3.16
	フランス	173,530,347,689	2.77
	スイス	164,219,821,255	2.62
	ドイツ	146,695,019,963	2.34
	オーストラリア	116,358,841,935	1.86
	オランダ	98,858,905,883	1.58
	デンマーク	55,125,129,110	0.88
	スウェーデン	54,907,118,444	0.88
	スペイン	44,493,432,810	0.71
	イタリア	35,426,429,397	0.57
	香港	29,904,804,948	0.48
	シンガポール	18,069,231,108	0.29
	フィンランド	16,635,758,821	0.27
	ベルギー	12,806,497,077	0.20
	ノルウェー	9,253,491,188	0.15
	イスラエル	5,719,091,553	0.09
	アイルランド	4,865,345,778	0.08

	オーストリア	3,020,305,033	0.05
	ルクセンブルク	3,010,959,595	0.05
	ニュージーランド	2,794,129,790	0.04
	ポルトガル	2,542,106,415	0.04
	パミューダ	790,538,962	0.01
	小計	5,977,161,378,035	95.45
投資証券	アメリカ	105,277,928,306	1.68
	オーストラリア	8,144,818,542	0.13
	フランス	2,382,275,903	0.04
	イギリス	1,986,049,527	0.03
	シンガポール	1,759,989,870	0.03
	香港	1,178,006,009	0.02
	ベルギー	442,044,419	0.01
	カナダ	299,163,421	0.00
	小計	121,470,275,997	1.94
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	163,131,047,283	2.61
純資産総額		6,261,762,701,315	100.00

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

その他の資産の投資状況

2024年 9月30日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	123,326,498,785	1.97
	買建	カナダ	5,604,854,875	0.09
	買建	ドイツ	18,373,218,593	0.29
	買建	オーストラリア	4,910,472,303	0.08
	買建	イギリス	6,352,267,101	0.10
	買建	スイス	4,228,187,184	0.07

（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。

新興国株式インデックスマザーファンド

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（％）
株式	香港	197,708,322,876	20.34
	インド	188,711,382,939	19.42
	台湾	172,753,007,132	17.77
	韓国	102,359,178,729	10.53
	ブラジル	40,034,446,103	4.12
	サウジアラビア	36,630,494,833	3.77

	中国	35,816,842,569	3.68
	南アフリカ	30,411,083,895	3.13
	アメリカ	29,542,652,784	3.04
	メキシコ	17,183,744,827	1.77
	インドネシア	16,203,098,786	1.67
	マレーシア	14,679,396,996	1.51
	タイ	14,289,628,589	1.47
	アラブ首長国連邦	10,819,059,303	1.11
	ポーランド	8,261,979,105	0.85
	カタール	7,219,126,029	0.74
	クウェート	6,435,862,128	0.66
	トルコ	5,719,186,851	0.59
	フィリピン	5,431,183,416	0.56
	ギリシャ	4,530,723,132	0.47
	チリ	3,799,847,515	0.39
	ハンガリー	2,332,099,527	0.24
	チェコ	1,134,428,676	0.12
	コロンビア	829,300,652	0.09
	小計	952,836,077,392	98.03
投資証券	メキシコ	872,048,651	0.09
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	18,276,635,494	1.88
純資産総額		971,984,761,537	100.00

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

その他の資産の投資状況

2024年 9月30日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	16,803,511,552	1.73

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

国内債券インデックスマザーファンド

投資状況

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（％）
国債証券	日本	247,710,984,520	84.69
地方債証券	日本	14,932,393,730	5.11
特殊債券	日本	12,174,661,611	4.16
社債券	日本	16,781,084,300	5.74
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	881,669,875	0.30

純資産総額	292,480,794,036	100.00
-------	-----------------	--------

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

その他の資産の投資状況

2024年 9月30日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
債券先物取引	買建	日本	289,300,000	0.10

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

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

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（％）
国債証券	アメリカ	166,752,939,426	45.43
	中国	39,445,390,475	10.75
	フランス	27,328,633,561	7.45
	イタリア	25,078,455,715	6.83
	ドイツ	21,730,399,058	5.92
	イギリス	19,553,588,868	5.33
	スペイン	16,472,557,121	4.49
	カナダ	7,287,114,809	1.99
	ベルギー	5,682,771,066	1.55
	オランダ	4,867,186,614	1.33
	オーストラリア	4,851,727,075	1.32
	オーストリア	4,160,079,935	1.13
	メキシコ	2,589,899,866	0.71
	フィンランド	1,905,603,096	0.52
	マレーシア	1,903,550,346	0.52
	ポーランド	1,869,061,270	0.51
	アイルランド	1,726,886,767	0.47
	シンガポール	1,603,023,267	0.44
	イスラエル	1,069,422,682	0.29
	ニュージーランド	918,832,831	0.25
	デンマーク	916,182,154	0.25
	スウェーデン	566,736,893	0.15
	ノルウェー	559,021,610	0.15
小計		358,839,064,505	97.76
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	8,205,805,863	2.24
純資産総額		367,044,870,368	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。

ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド

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（％）
国債証券	アメリカ	6,836,471,430	94.81
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	374,614,650	5.19
純資産総額		7,211,086,080	100.00

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

2【設定及び解約の実績】

【三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第2計算期間	21,162,714,048	2,322,836,403	19,766,238,377
第3計算期間	35,213,444,969	7,042,824,390	47,936,858,956
第4計算期間	14,107,298,059	18,996,501,741	43,047,655,274
第5計算期間	4,023,376,097	22,015,232,045	25,055,799,326
第6計算期間	5,274,825,327	3,244,462,370	27,086,162,283
第7計算期間	1,987,264,985	3,238,817,169	25,834,610,099
第8計算期間	525,345,517	3,573,208,348	22,786,747,268
第9計算期間	519,013,721	4,040,116,658	19,265,644,331
第10計算期間	66,798,497	1,589,190,634	17,743,252,194
第11計算期間	28,533,597	2,769,604,805	15,002,180,986
第12中間計算期間	19,034,416	1,115,286,095	13,905,929,307

【三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第2計算期間	25,095,132,460	5,444,511,240	20,955,742,188
第3計算期間	43,638,216,569	10,852,980,012	53,740,978,745
第4計算期間	5,975,078,368	21,959,271,960	37,756,785,153
第5計算期間	5,921,593,950	21,334,148,864	22,344,230,239
第6計算期間	5,496,470,932	2,758,727,653	25,081,973,518
第7計算期間	2,340,829,162	3,484,699,835	23,938,102,845
第8計算期間	424,139,994	3,482,947,344	20,879,295,495
第9計算期間	528,655,909	4,242,306,956	17,165,644,448
第10計算期間	255,946,355	1,417,067,402	16,004,523,401
第11計算期間	139,732,101	2,443,677,046	13,700,578,456
第12中間計算期間	53,243,343	711,812,285	13,042,009,514

【三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第2計算期間	1,152,904,287	291,375,437	986,209,120
第3計算期間	551,196,595	338,236,484	1,199,169,231
第4計算期間	468,990,819	616,395,704	1,051,764,346
第5計算期間	7,312,217,505	1,286,533,821	7,077,448,030
第6計算期間	1,589,895,766	894,060,789	7,773,283,007
第7計算期間	619,203,622	808,866,213	7,583,620,416
第8計算期間	97,832,324	1,539,250,882	6,142,201,858
第9計算期間	79,829,486	1,899,825,819	4,322,205,525
第10計算期間	31,065,353	445,103,881	3,908,166,997
第11計算期間	30,738,192	497,568,827	3,441,336,362

第12中間計算期間	5,150,826	349,052,397	3,097,434,791
-----------	-----------	-------------	---------------

3【ファンドの経理状況】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2024年3月26日から2024年9月25日まで）の中間財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により中間監査を受けております。

【三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 [2024年 3月25日現在]	第12期中間計算期間末 [2024年 9月25日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	453,658,673	321,188,037
親投資信託受益証券	17,198,333,625	15,564,625,618
未収入金	-	118,000,000
未収利息	875	1,867
流動資産合計	17,651,993,173	16,003,815,522
資産合計	17,651,993,173	16,003,815,522
負債の部		
流動負債		
未払解約金	58,202,233	16,107,473
未払受託者報酬	4,763,102	3,917,012
未払委託者報酬	119,077,547	95,198,084
その他未払費用	342,887	331,060
流動負債合計	182,385,769	115,553,629
負債合計	182,385,769	115,553,629
純資産の部		
元本等		
元本	15,002,180,986	13,905,929,307
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	2,467,426,418	1,982,332,586
（分配準備積立金）	982,389,090	909,385,947
元本等合計	17,469,607,404	15,888,261,893
純資産合計	17,469,607,404	15,888,261,893
負債純資産合計	17,651,993,173	16,003,815,522

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期中間計算期間 自 2023年 3月28日 至 2023年 9月27日	第12期中間計算期間 自 2024年 3月26日 至 2024年 9月25日
営業収益		
受取利息	1,604	252,396
有価証券売買等損益	251,578,565	△208,888,689
営業収益合計	251,580,169	△208,636,293
営業費用		
支払利息	153,423	-
受託者報酬	5,199,161	3,917,012
委託者報酬	129,978,953	95,198,084
その他費用	374,274	331,060
営業費用合計	135,705,811	99,446,156
営業利益又は営業損失（△）	115,874,358	△308,082,449
経常利益又は経常損失（△）	115,874,358	△308,082,449
中間純利益又は中間純損失（△）	115,874,358	△308,082,449
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	15,718,943	△3,363,940
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,452,439,034	2,467,426,418
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,259,448	3,055,000
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,259,448	3,055,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	90,240,923	183,430,323
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	90,240,923	183,430,323
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,463,612,974	1,982,332,586

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
--------------------	---

（中間貸借対照表に関する注記）

	第11期 [2024年 3月25日現在]	第12期中間計算期間末 [2024年 9月25日現在]
1. 期首元本額	17,743,252,194円	15,002,180,986円
期中追加設定元本額	28,533,597円	19,034,416円
期中一部解約元本額	2,769,604,805円	1,115,286,095円
2. 受益権の総数	15,002,180,986口	13,905,929,307口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

第11期中間計算期間 自 2023年 3月28日 至 2023年 9月27日	第12期中間計算期間 自 2024年 3月26日 至 2024年 9月25日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	第11期 [2024年 3月25日現在]	第12期中間計算期間末 [2024年 9月25日現在]
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(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）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第11期 [2024年 3月25日現在]	第12期中間計算期間末 [2024年 9月25日現在]
1口当たり純資産額	1.1645円	1.1426円
(1万口当たり純資産額)	(11,645円)	(11,426円)

【三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 [2024年 3月25日現在]	第12期中間計算期間末 [2024年 9月25日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	484,289,523	573,285,486
親投資信託受益証券	20,208,866,603	18,662,380,087
未収利息	934	3,332
流動資産合計	20,693,157,060	19,235,668,905
資産合計	20,693,157,060	19,235,668,905
負債の部		
流動負債		
未払解約金	16,096,023	3,937,910
未払受託者報酬	5,314,224	5,557,991
未払委託者報酬	132,855,539	138,949,819
その他未払費用	382,568	400,112
流動負債合計	154,648,354	148,845,832
負債合計	154,648,354	148,845,832
純資産の部		
元本等		
元本	13,700,578,456	13,042,009,514
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	6,837,930,250	6,044,813,559
（分配準備積立金）	3,963,559,155	3,757,972,828
元本等合計	20,538,508,706	19,086,823,073
純資産合計	20,538,508,706	19,086,823,073
負債純資産合計	20,693,157,060	19,235,668,905

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期中間計算期間 自 2023年 3月28日 至 2023年 9月27日	第12期中間計算期間 自 2024年 3月26日 至 2024年 9月25日
営業収益		
受取利息	1,608	260,103
有価証券売買等損益	1,275,667,101	△313,100,101
営業収益合計	1,275,668,709	△312,839,998
営業費用		
支払利息	155,455	-
受託者報酬	5,555,039	5,557,991
委託者報酬	138,875,903	138,949,819
その他費用	399,902	400,112
営業費用合計	144,986,299	144,907,922
営業利益又は営業損失（△）	1,130,682,410	△457,747,920
経常利益又は経常損失（△）	1,130,682,410	△457,747,920
中間純利益又は中間純損失（△）	1,130,682,410	△457,747,920
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	56,642,351	7,406,646
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,981,399,794	6,837,930,250
剰余金増加額又は欠損金減少額	20,683,786	27,326,690
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	20,683,786	27,326,690
剰余金減少額又は欠損金増加額	277,918,916	355,288,815
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	277,918,916	355,288,815
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	4,798,204,723	6,044,813,559

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
--------------------	---

（中間貸借対照表に関する注記）

	第11期 [2024年 3月25日現在]	第12期中間計算期間末 [2024年 9月25日現在]
1. 期首元本額	16,004,523,401円	13,700,578,456円
期中追加設定元本額	139,732,101円	53,243,343円
期中一部解約元本額	2,443,677,046円	711,812,285円
2. 受益権の総数	13,700,578,456口	13,042,009,514口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

第11期中間計算期間 自 2023年 3月28日 至 2023年 9月27日	第12期中間計算期間 自 2024年 3月26日 至 2024年 9月25日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	第11期 [2024年 3月25日現在]	第12期中間計算期間末 [2024年 9月25日現在]
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	（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）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	第11期 [2024年 3月25日現在]	第12期中間計算期間末 [2024年 9月25日現在]
1口当たり純資産額	1.4991円	1.4635円
(1万口当たり純資産額)	(14,991円)	(14,635円)

【三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 [2024年 3月25日現在]	第12期中間計算期間末 [2024年 9月25日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	122,138,538	102,959,232
親投資信託受益証券	4,407,477,129	3,941,946,523
未収入金	24,000,000	26,000,000
未収利息	235	598
流動資産合計	4,553,615,902	4,070,906,353
資産合計	4,553,615,902	4,070,906,353
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,709,946	9,431,705
未払受託者報酬	1,177,331	1,193,768
未払委託者報酬	29,433,176	29,844,187
その他未払費用	84,706	85,889
流動負債合計	39,405,159	40,555,549
負債合計	39,405,159	40,555,549
純資産の部		
元本等		
元本	3,441,336,362	3,097,434,791
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,072,874,381	932,916,013
（分配準備積立金）	259,318,272	233,031,855
元本等合計	4,514,210,743	4,030,350,804
純資産合計	4,514,210,743	4,030,350,804
負債純資産合計	4,553,615,902	4,070,906,353

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期中間計算期間 自 2023年 3月28日 至 2023年 9月27日	第12期中間計算期間 自 2024年 3月26日 至 2024年 9月25日
営業収益		
受取利息	355	57,700
有価証券売買等損益	253,917,919	10,079,358
営業収益合計	253,918,274	10,137,058
営業費用		
支払利息	30,904	-
受託者報酬	1,221,595	1,193,768
委託者報酬	30,539,973	29,844,187
その他費用	87,894	85,889
営業費用合計	31,880,366	31,123,844
営業利益又は営業損失（△）	222,037,908	△20,986,786
経常利益又は経常損失（△）	222,037,908	△20,986,786
中間純利益又は中間純損失（△）	222,037,908	△20,986,786
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	7,068,972	11,889,137
期首剰余金又は期首欠損金（△）	441,967,206	1,072,874,381
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,372,011	1,745,848
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,372,011	1,745,848
剰余金減少額又は欠損金増加額	19,912,879	108,828,293
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	19,912,879	108,828,293
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	638,395,274	932,916,013

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
--------------------	---

（中間貸借対照表に関する注記）

	第11期 [2024年 3月25日現在]	第12期中間計算期間末 [2024年 9月25日現在]
1. 期首元本額	3,908,166,997円	3,441,336,362円
期中追加設定元本額	30,738,192円	5,150,826円
期中一部解約元本額	497,568,827円	349,052,397円
2. 受益権の総数	3,441,336,362口	3,097,434,791口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

第11期中間計算期間 自 2023年 3月28日 至 2023年 9月27日	第12期中間計算期間 自 2024年 3月26日 至 2024年 9月25日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	第11期 [2024年 3月25日現在]	第12期中間計算期間末 [2024年 9月25日現在]
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(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）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第11期 [2024年 3月25日現在]	第12期中間計算期間末 [2024年 9月25日現在]
1口当たり純資産額	1.3118円	1.3012円
(1万口当たり純資産額)	(13,118円)	(13,012円)

（参考）

当ファンドの主要投資対象の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

貸借対照表

(単位：円)

[2024年 9月25日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	25,436,996,926
株式	1,472,132,217,360
派生商品評価勘定	685,251,500
未収入金	68,625,727
未収配当金	609,935,169
未収利息	147,869
その他未収収益	9,859,557
差入委託証拠金	1,159,112,302
流動資産合計	1,500,102,146,410
資産合計	1,500,102,146,410
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,164,950
前受金	734,015,000
未払金	52,684,830
未払解約金	992,713,665
未払利息	4,109,176
受入担保金	10,938,074,095
流動負債合計	12,723,761,716
負債合計	12,723,761,716
純資産の部	
元本等	
元本	456,727,705,427
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,030,650,679,267
元本等合計	1,487,378,384,694
純資産合計	1,487,378,384,694
負債純資産合計	1,500,102,146,410

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年 9月25日現在]
1. 期首	2024年 3月26日
期首元本額	417,799,026,755円
期中追加設定元本額	122,818,354,007円
期中一部解約元本額	83,889,675,335円
元本の内訳※	
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスオープン	6,686,113,682円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）	769,382,300円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）	3,737,910,660円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）	3,914,562,594円
三菱ＵＦＪ トピックスオープン（確定拠出年金）	3,805,089,396円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	5,649,178,477円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	33,084,695,494円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	42,047,198,245円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）	81,821,364円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）	236,454,799円
ファンド・マネジャー（国内株式）	308,625,493円
eMAXIS TOPIXインデックス	8,486,602,907円

	[2024年 9月25日現在]
eMAXIS バランス（8資産均等型）	2,063,348,715円
eMAXIS バランス（波乗り型）	176,794,829円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	2,842,587,947円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	831,406,822円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	1,127,702,702円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	1,158,114,083円
eMAXIS Slim 国内株式（TOPIX）	67,748,790,546円
国内株式セレクション（ラップ向け）	6,483,008,725円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	11,419,373,383円
つみたて日本株式（TOPIX）	12,563,437,483円
つみたて8資産均等バランス	5,799,210,854円
つみたて4資産均等バランス	2,237,125,360円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	3,432,706円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	5,686,166円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	10,490,357円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	695,163,994円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	999,002,735円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	708,656,257円
三菱UFJ DC年金バランス（株式15）	540,514,197円
三菱UFJ DC年金バランス（株式40）	1,822,864,976円
三菱UFJ DC年金バランス（株式65）	4,591,979,574円
eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）	1,773,600,409円
三菱UFJ DC年金インデックス（国内株式）	5,582,325,992円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	707,738,373円
三菱UFJ DC年金バランス（株式25）	156,834,522円
国内株式インデックス・オープン（ラップ向け）	22,994,133,319円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金）	355,416,344円
ラップ向けインデックスf 国内株式	4,173,981,587円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）	176,188,307円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）	4,645,828,089円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（積極型）	2,959,845,493円
三菱UFJ DC年金バランス（株式80）	66,787,772円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	19,708,199円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	26,070,265円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070（確定拠出年金）	7,776,241円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド・アネックス（為替リスク軽減型）コンサバティブコース	3,171,994円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド・アネックス（為替リスク軽減型）スタンダードコース	62,550,874円
eMAXIS/PayPay証券 全世界バランス	324,726円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	244,363,918円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	995,160,771円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	382,172,436円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	47,202,974円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	16,763,380円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	127,411,532円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	911,827,507円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	161,725,181円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	204,942,564円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	868,067,126円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	708,131,725円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	1,311,132,105円
三菱UFJ トピックスオープン	916,276,675円
三菱UFJ DCトピックスオープン	8,078,752,480円
三菱UFJ トピックスオープンVA（適格機関投資家限定）	39,205,638円
三菱UFJ トピックスインデックスファンドVA（適格機関投資家限定）	3,428,851,252円

[2024年 9月25日現在]

三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,937,826円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,437,691,957円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	56,360,008円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	1,148,184,982円
MUAM 日本株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	57,112,369,263円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	180,958,812円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	207,809円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	123,328円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	183,855,340円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	308,627,140円
MUAM インデックスファンドＴＯＰＩＸｉ（適格機関投資家限定）	4,690,755,246円
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	813,774,092円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	244,420,180円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	362,565,119円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	97,031,469円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	153,956,107円
MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	26,546,310円
MUKAM 日本株式インデックスファンド２（適格機関投資家限定）	3,840,842,177円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション２（適格機関投資家限定）	310,020,998円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）２（適格機関投資家転売制限付）	33,606,170円
マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定）	275,859円
日米コアバランス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	96,695,100円
日本株式インデックスファンドＳ	4,590,723,084円
グローバルバランスオープンＶ（適格機関投資家限定）	9,757,553円
MUAM グローバルバランス（退職給付信託向け）（適格機関投資家限定）	9,798,010,251円
MUKAM アセットアロケーションファンド２０２０－０７（適格機関投資家限定）	35,419,113円
MUKAM 米国国債プラス日本株式ファンド２０２０－０７（適格機関投資家限定）	79,523,277円
MUKAM アセットアロケーションファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	34,940,101円
MUKAM アセットアロケーションファンド２０２０－１１（適格機関投資家限定）	34,951,319円
MUKAM アセットアロケーションファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	34,935,203円
MUKAM アセットアロケーションファンド２０２１－０５（適格機関投資家限定）	35,058,940円
MUKAM 日米コアバランス ２０２１－０７（適格機関投資家限定）	259,774,347円
MUKAM アセットアロケーションファンド２０２１－１１（適格機関投資家限定）	34,874,281円
MUKAM アセットアロケーションファンド２０２２－０１（適格機関投資家限定）	35,762,664円
MUKAM 日米コアバランス（除く米国株）２０２２－０３（適格機関投資家限定）	511,142,581円
MUKAM アセットアロケーションファンド２０２２－０３（適格機関投資家限定）	37,565,083円
MUKAM アセットアロケーションファンド２０２２－０５（適格機関投資家限定）	38,774,804円
MUKAM アセットアロケーションファンド２０２２－０７（適格機関投資家限定）	39,792,135円
MUKAM アセットアロケーションファンド２０２２－０９（適格機関投資家限定）	39,241,585円
MUKAM アセットアロケーションファンド２０２２－１１（適格機関投資家限定）	39,102,095円

	[2024年 9月25日現在]
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01（適格機関投資家限定）	39,096,327円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03（適格機関投資家限定）	39,100,255円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05（適格機関投資家限定）	39,088,327円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	5,503,461,776円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	2,615,018円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	6,264,861円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	1,463,182円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	5,601,368円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	426,164,989円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	59,949,032円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	2,899,455円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	24,763,245円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	1,382,324円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	14,414,983円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,581,245,878円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	309,028,551円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	1,324,965,606円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	1,280,507,807円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	1,257,131,489円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	61,222,809,654円
合計	456,727,705,427円
2. 貸付有価証券 貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っております。 株式	10,433,412,120円
3. 受益権の総数	456,727,705,427口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年 9月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）
取引の時価等に関する事項
株式関連

[2024年 9月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	14,535,610,000	—	15,219,015,000	683,405,000

合計	14,535,610,000	—	15,219,015,000	683,405,000
----	----------------	---	----------------	-------------

(注) 時価の算定方法

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

(1口当たり情報)

	[2024年 9月25日現在]
1口当たり純資産額	3.2566円
(1万口当たり純資産額)	(32,566円)

外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年 9月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	38,357,604,323
コール・ローン	12,027,267,286
株式	5,979,546,035,856
投資証券	123,304,126,255
派生商品評価勘定	1,872,582,838
未収入金	43,554,437
未収配当金	6,431,425,766
未収利息	69,916
差入委託証拠金	88,227,850,854
流動資産合計	6,249,810,517,531
資産合計	6,249,810,517,531
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	72,497,544
未払解約金	715,341,341
流動負債合計	787,838,885
負債合計	787,838,885
純資産の部	
元本等	
元本	881,396,238,010
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	5,367,626,440,636
元本等合計	6,249,022,678,646
純資産合計	6,249,022,678,646
負債純資産合計	6,249,810,517,531

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 9月25日現在]
1. 期首	2024年 3月26日
期首元本額	721,351,336,039円
期中追加設定元本額	201,234,406,491円
期中一部解約元本額	41,189,504,520円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）	172,055,852円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）	915,061,933円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）	930,121,431円
MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信	3,174,875,099円
MAXIS 全世界株式（オール・カントリー）上場投信	6,577,686,813円
三菱UFJ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	1,263,317,468円
三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	8,099,319,129円
三菱UFJ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	9,990,640,995円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	38,939,335円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）	109,545,090円
ファンド・マネジャー（海外株式）	776,167円
eMAXIS 先進国株式インデックス	14,259,082,282円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	957,192,591円
eMAXIS バランス（波乗り型）	35,665,056円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	1,688,536,156円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	174,227,995円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	270,964,942円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	267,573,071円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	109,289,236,784円
海外株式セクション（ラップ向け）	2,283,073,482円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	5,309,151,724円
つみたて先進国株式	38,966,639,193円
つみたて8資産均等バランス	2,672,714,136円
つみたて4資産均等バランス	1,036,192,956円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	2,044,734円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,635,389円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	7,829,831円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	160,454,737円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	223,784,546円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	167,687,644円
三菱UFJ DC年金バランス（株式15）	64,214,494円
三菱UFJ DC年金バランス（株式40）	519,747,065円
三菱UFJ DC年金バランス（株式65）	1,550,480,357円
eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）	68,093,326,212円
eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）	826,976,059円
三菱UFJ DC年金インデックス（先進国株式）	5,157,088,258円
eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）	489,782,059,564円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	159,879,618円
三菱UFJ DC年金バランス（株式25）	41,922,831円
つみたて全世界株式	4,863,348,605円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金）	83,941,924円
ラップ向けインデックスf 先進国株式	2,566,049,816円
三菱UFJ DC年金バランス（株式80）	69,824,361円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	1,258,710,355円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	43,755,238円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	5,407,108円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	7,259,413円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070（確定拠出年金）	1,835,385円
eMAXIS/PayPay証券 全世界バランス	425,406円

	[2024年 9月25日現在]
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	34,320,568,966円
eMAXIS 全世界株式インデックス	7,186,905,653円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	407,490,487円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	896,636,175円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	173,160円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	642,991,977円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	126,513,667円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	423,856,062円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	82,872,820円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	122,203,956円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	557,176,839円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	468,418,796円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	980,248,550円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA（適格機関投資家限定）	987,191,637円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	4,125,927円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	2,657,655,734円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	26,371,571円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	533,300,352円
MUAM 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	8,287,178,625円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	57,105円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	426,737,159円
MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	3,827,746,266円
アドバンスト・バランスI（FOFs用）（適格機関投資家限定）	5,976,634円
アドバンスト・バランスII（FOFs用）（適格機関投資家限定）	44,336,907円
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	1,325,350,598円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	404,001,621円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	119,725,380円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	57,638,012円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	809,736,954円
MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	71,042,826円
MUKAM 外国株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	2,534,044,716円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2（適格機関投資家限定）	101,344,160円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付）	54,090,688円
マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定）	195,260円
海外株式インデックスファンドS	11,693,155,991円
外国株式インデックスオープンV（適格機関投資家限定）	417,399,416円
全世界株式インデックスファンドV（適格機関投資家限定）	235,167,380円
グローバルバランスオープンV（適格機関投資家限定）	3,983,295円
全世界株式（除く日本）インデックスファンドV（適格機関投資家限定）	95,943,017円
MUAM グローバルバランス（退職給付信託向け）（適格機関投資家限定）	4,776,531,798円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	3,010,455,585円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	607,734円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	1,465,664円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	387,700円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	1,629,356円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	19,654,761円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	671,977円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	5,731,256円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	644,626円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	6,737,993円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	7,404,849,874円

	[2024年 9月25日現在]
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)	71,624,927円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)	307,560,823円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)	339,185,178円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型)	364,665,789円
合計	881,396,238,010円
２．受益権の総数	881,396,238,010口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年 9月25日現在]
１．貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
２．時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
３．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

[2024年 9月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	147,444,344,514	—	149,255,419,025	1,811,074,511
合計		147,444,344,514	—	149,255,419,025	1,811,074,511

（注）時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

[2024年 9月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	11,419,268,199	—	11,395,590,543	△23,677,656
	カナダドル	469,495,476	—	471,428,807	1,933,331
	オーストラリアドル	287,498,439	—	289,044,811	1,546,372

イギリスポンド	607,868,657	—	609,252,906	1,384,249
スイスフラン	264,400,704	—	265,037,925	637,221
香港ドル	84,916,056	—	84,695,208	△220,848
シンガポールドル	54,765,996	—	54,956,252	190,256
ニュージーランド ドル	74,753,436	—	75,634,877	881,441
スウェーデンク ローネ	159,279,204	—	160,416,912	1,137,708
デンマーククロ ーネ	117,253,916	—	117,863,840	609,924
ユーロ	1,171,391,271	—	1,175,980,056	4,588,785
合計	14,710,891,354	—	14,699,902,137	△10,989,217

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報）

	[2024年 9月25日現在]
1口当たり純資産額	7.0899円
(1万口当たり純資産額)	(70,899円)

新興国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	[2024年 9月25日現在]
資産の部	
流動資産	
預金	23,832,315,384
コール・ローン	658,056,360
株式	903,213,561,427
投資証券	889,603,914
派生商品評価勘定	1,750,274,252
未収入金	19,690,650
未収配当金	1,829,465,556
未収利息	3,825
差入委託証拠金	5,681,587,218
流動資産合計	937,874,558,586
資産合計	937,874,558,586
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,681,421
未払金	1,903,837
未払解約金	28,071,064
流動負債合計	52,656,322
負債合計	52,656,322
純資産の部	

[2024年 9月25日現在]

元本等	
元本	239,915,651,427
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	697,906,250,837
元本等合計	937,821,902,264
純資産合計	937,821,902,264
負債純資産合計	937,874,558,586

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。なお、ロシア株式（DR（預託証券）を含みます。以下、同じ。）の評価については、「追加情報」に記載しております。投資証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 9月25日現在]
1. 期首	2024年 3月26日
期首元本額	194,952,402,151円
期中追加設定元本額	49,251,435,549円
期中一部解約元本額	4,288,186,273円
元本の内訳※	
MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信	1,455,667,058円
eMAXIS 新興国株式インデックス	10,244,700,284円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,745,449,515円
eMAXIS バランス（波乗り型）	51,833,473円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	621,493,397円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	9,809,649,667円
eMAXIS Slim 新興国株式インデックス	43,566,360,025円
つみたて新興国株式	9,775,063,733円
つみたて8資産均等バランス	4,943,599,110円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	632,271円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,545,490円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	7,959,556円
eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）	15,084,550,701円
eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）	1,521,822,706円
eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）	108,499,655,576円
新興国株式インデックス・オープン（ラップ向け）	5,291,831,541円
つみたて全世界株式	1,077,275,965円
ラップ向けインデックスf 新興国株式	1,019,597,969円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）	3,434,496円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）	1,303,286,050円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（積極型）	1,652,320,033円
eMAXIS/PayPay証券 全世界バランス	88,538円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	17,515,704,643円
新興国株式インデックスオープン	414,330,642円
eMAXIS 全世界株式インデックス	1,592,807,270円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	44,810円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	37,801,668円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	234,960,352円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	253,088,754円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	995,204,242円
MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	848,016,741円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	21,214,638円
全世界株式インデックスファンドV（適格機関投資家限定）	52,096,522円

	[2024年 9月25日現在]
グローバルバランスオープンV（適格機関投資家限定）	881,153円
全世界株式（除く日本）インデックスファンドV（適格機関投資家限定）	21,223,417円
MUKAM バランスファンド2019-12（適格機関投資家限定）	54,031,623円
MUKAM バランスファンド2020-07（適格機関投資家限定）	53,657,010円
MUKAM バランスファンド2020-10（適格機関投資家限定）	53,388,985円
MUKAM バランスファンド2021-03（適格機関投資家限定）	47,245,663円
MUKAM バランスファンド2021-06（適格機関投資家限定）	42,136,140円
合計	239,915,651,427円
2. 受益権の総数	239,915,651,427口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年 9月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	（1）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （2）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）
取引の時価等に関する事項
株式関連

[2024年 9月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	34,397,219,179	—	36,147,439,009	1,750,219,830
合計		34,397,219,179	—	36,147,439,009	1,750,219,830

（注）時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

[2024年 9月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				

	アメリカドル	575,077,541	—	573,509,014	△1,568,527
	メキシコペソ	519,127,000	—	519,092,000	△35,000
	ニュー台湾ドル	3,511,560,000	—	3,490,578,000	△20,982,000
	売建				
	アメリカドル	1,554,870,100	—	1,554,910,245	△40,145
	オフショア元	269,541	—	270,868	△1,327
	合計	6,160,904,182	—	6,138,360,127	△22,626,999

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報）

	[2024年 9月25日現在]
1口当たり純資産額	3.9090円
(1万口当たり純資産額)	(39,090円)

（追加情報）

自 2024年 3月26日 至 2024年 9月25日
当ファンドは、ロシア株式（DR（預託証券）を含みます。以下、「当該株式」）を組み入れております。2022年 2月24日に発生したロシアのウクライナ侵攻による当ファンドへの影響は以下の通りです。 ロシアが、2022年 2月24日に首都キーウを含むウクライナ国内の複数の都市への軍事侵攻に踏み切って以降、期末日時点においてロシア軍とウクライナ軍の戦闘が続いております。 2022年 2月24日以降、ロシアのウクライナ侵攻を受けた米欧の経済制裁やそれに対抗措置をロシアが設けたことにより、取引の規制、決済機構やSWIFTからの除外による取引後の受渡が行えない状況となり、市場でのロシア関連資産の取引が成立しない状況となりました。このため、組入株式の時価については金融商品取引所等における最終相場で評価していますが、当該株式の取引停止等に伴い、取引停止日以降の最終相場の価格が入手できない状況となりました。当該株式のロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引についても、実現が困難な状況となっております。 時価の算定に関する会計基準に基づきますと、組入有価証券に係る時価は秩序ある取引が行われると想定した場合の出口価格である必要があり、上記状況を総合的に勘案した結果、当ファンドが組み入れている当該株式において、2022年 3月14日付けで評価額をゼロとすることとし、期末日時点においても当該取り扱いを継続しております。2022年 3月11日時点の当ファンドにおける当該株式の保有割合は0.55%です。 なお、2022年 3月24日にモスクワ証券取引所は一部取引を再開しておりますが、ロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引について、実現が困難な状況に変わりありません。 今後、当該株式のロシア国外の投資家による取引の再開、市場の流動性の回復、最終相場価格の提供再開、ならびに当該株式に係る証券決済や為替取引の実現等の変化があれば、状況を総合的に判断の上、その評価額をゼロから回復させる可能性もあります。

国内債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[2024年 9月25日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,150,149,180
国債証券	250,563,813,580
地方債証券	14,671,086,720
特殊債券	12,195,601,268
社債券	16,808,927,000
派生商品評価勘定	958,130
未収利息	265,694,406
前払費用	46,414,259

[2024年 9月25日現在]

差入委託証拠金	3,831,438
流動資産合計	296,706,475,981
資産合計	296,706,475,981
負債の部	
流動負債	
前受金	1,160,000
未払金	400,000,000
未払解約金	643,768,843
流動負債合計	1,044,928,843
負債合計	1,044,928,843
純資産の部	
元本等	
元本	321,643,231,715
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△25,981,684,577
元本等合計	295,661,547,138
純資産合計	295,661,547,138
負債純資産合計	296,706,475,981

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 9月25日現在]
1. 期首	2024年 3月26日
期首元本額	221,057,167,943円
期中追加設定元本額	272,347,877,103円
期中一部解約元本額	171,761,813,331円
元本の内訳※	
ファンド・マネジャー（国内債券）	18,220,783,295円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	32,878,815,093円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	1,132,249,810円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	51,247,466円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	66,772,531円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	8,624,911,301円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	4,712,603,109円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	1,426,563,394円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	13,718,258,454円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	4,390,808,174円
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	28,702,506,076円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	8,640,000,040円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	29,779,224,823円
MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	2,475,373,998円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	165,634,575,475円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付）	1,188,538,676円
合計	321,643,231,715円
2. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	25,981,684,577円
3. 受益権の総数	321,643,231,715口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年 9月25日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませ
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
 該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

債券関連

[2024年 9月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	289,060,000	—	290,020,000	960,000
合計		289,060,000	—	290,020,000	960,000

（注）時価の算定方法

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

（1口当たり情報）

	[2024年 9月25日現在]
1口当たり純資産額	0.9192円
(1万口当たり純資産額)	(9,192円)

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[2024年 9月25日現在]	
資産の部	
流動資産	
預金	1,053,528,459
コール・ローン	4,877,305,237
国債証券	361,044,984,792
派生商品評価勘定	1,145,995,241
未収入金	45,403,669
未収利息	2,699,527,169
前払費用	342,450,364
流動資産合計	371,209,194,931
資産合計	371,209,194,931
負債の部	
流動負債	

[2024年 9月25日現在]

派生商品評価勘定	729,118,668
未払金	3,024,419,226
未払解約金	35,274,369
流動負債合計	3,788,812,263
負債合計	3,788,812,263
純資産の部	
元本等	
元本	324,414,680,830
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	43,005,701,838
元本等合計	367,420,382,668
純資産合計	367,420,382,668
負債純資産合計	371,209,194,931

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 9月25日現在]
1. 期首	2024年 3月26日
期首元本額	296,996,179,772円
期中追加設定元本額	58,407,901,001円
期中一部解約元本額	30,989,399,943円
元本の内訳※	
eMAXIS 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）	1,029,868,618円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	17,507,402,182円
ラップ向けインデックスf 先進国債券（為替ヘッジあり）	6,483,952,808円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	599,761,049円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	41,011,804円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	54,922,170円
eMAXIS/PayPay証券 全世界バランス	79,555円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	3,489,091,306円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	4,178,574,896円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	1,155,848,245円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	5,427,990,015円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	1,728,849,024円
eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）	92,114,851円
MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）	144,479,885,098円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	9,180,661,130円
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	11,451,227,590円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	3,469,324,585円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	295,924,315円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	11,348,307,716円
MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	984,215,803円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	11,787,587,372円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスオープン（適格機関投資家限定）	6,863,880,285円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2（適格機関投資家限定）	241,840,068円

	[2024年 9月25日現在]
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	65,859,100,330円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付）	484,154,116円
マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定）	828,248円
MUKAM バランスファンド2019-12（適格機関投資家限定）	2,485,373,732円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07（適格機関投資家限定）	275,037,850円
MUKAM バランスファンド2020-07（適格機関投資家限定）	2,468,142,125円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09（適格機関投資家限定）	271,318,100円
MUKAM バランスファンド2020-10（適格機関投資家限定）	2,455,813,499円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11（適格機関投資家限定）	271,402,571円
MUKAM バランスファンド2021-03（適格機関投資家限定）	2,173,229,942円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03（適格機関投資家限定）	271,281,132円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05（適格機関投資家限定）	272,241,941円
MUKAM バランスファンド2021-06（適格機関投資家限定）	2,233,271,601円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11（適格機関投資家限定）	270,807,832円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01（適格機関投資家限定）	277,720,836円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03（適格機関投資家限定）	291,655,171円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05（適格機関投資家限定）	301,089,600円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07（適格機関投資家限定）	309,002,920円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09（適格機関投資家限定）	310,226,910円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11（適格機関投資家限定）	310,178,316円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01（適格機関投資家限定）	310,160,990円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03（適格機関投資家限定）	310,160,883円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05（適格機関投資家限定）	310,161,700円
合計	324,414,680,830円
2. 受益権の総数	324,414,680,830口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年 9月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はあります。
2. 時価の算定方法	（1）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （2）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[2024年 9月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	1,445,652,180	—	1,441,695,582	△3,956,598
	カナダドル	61,599,480	—	61,919,234	319,754
	オーストラリアドル	124,598,430	—	125,460,379	861,949
	イギリスポンド	186,054,730	—	186,610,540	555,810
	ユーロ	831,463,900	—	835,651,177	4,187,277
	売建				
	アメリカドル	168,150,644,695	—	167,079,102,446	1,071,542,249
	カナダドル	7,359,183,031	—	7,342,006,621	17,176,410
	オーストラリアドル	4,871,304,682	—	4,904,467,597	△33,162,915
	イギリスポンド	19,712,742,122	—	19,956,594,240	△243,852,118
	シンガポールドル	1,601,276,750	—	1,613,014,485	△11,737,735
	マレーシアリンギット	1,862,216,070	—	1,942,803,720	△80,587,650
	ニュージーランドドル	926,007,550	—	931,963,825	△5,956,275
	スウェーデンクローネ	568,018,523	—	570,551,753	△2,533,230
	ノルウェークローネ	576,315,252	—	577,788,399	△1,473,147
	デンマーククローネ	923,848,992	—	925,961,520	△2,112,528
	メキシコペソ	2,573,422,764	—	2,635,972,719	△62,549,955
	イスラエルシェケル	1,111,688,396	—	1,076,380,760	35,307,636
	ポーランドズロチ	1,883,599,200	—	1,904,190,318	△20,591,118
	中国元	40,039,675,286	—	40,023,952,566	15,722,720
	ユーロ	109,123,927,115	—	109,384,211,078	△260,283,963
合計		363,933,239,148	—	363,520,298,959	416,876,573

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（１口当たり情報）

	[2024年 9月25日現在]
1口当たり純資産額	1.1326円
(1万口当たり純資産額)	(11,326円)

ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	[2024年 9月25日現在]
資産の部	
流動資産	
預金	43,154,272
コール・ローン	107,734,292
国債証券	6,871,673,806
派生商品評価勘定	116,740,275
未収入金	15,797,430
未収利息	74,280,746
前払費用	16,287,829
流動資産合計	7,245,668,650
資産合計	7,245,668,650
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,552,547
未払解約金	26,000,000
流動負債合計	27,552,547
負債合計	27,552,547
純資産の部	
元本等	
元本	7,584,764,545
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△366,648,442
元本等合計	7,218,116,103
純資産合計	7,218,116,103
負債純資産合計	7,245,668,650

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 9月25日現在]
1. 期首	2024年 3月26日
期首元本額	10,662,765,639円
期中追加設定元本額	1,991,705,158円
期中一部解約元本額	5,069,706,252円
元本の内訳※	
eMAXIS 新興国債券インデックス（為替ヘッジあり）	1,843,518,462円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	1,387,131,324円
MUKAM バランスファンド2019-12（適格機関投資家限定）	273,083,307円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07（適格機関投資家限定）	192,653,893円

	[2024年 9月25日現在]
MUKAM バランスファンド2020-07（適格機関投資家限定）	271,189,965円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09（適格機関投資家限定）	190,050,265円
MUKAM バランスファンド2020-10（適格機関投資家限定）	269,835,343円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11（適格機関投資家限定）	190,110,517円
MUKAM バランスファンド2021-03（適格機関投資家限定）	238,786,149円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03（適格機関投資家限定）	190,002,827円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05（適格機関投資家限定）	190,675,753円
MUKAM バランスファンド2021-06（適格機関投資家限定）	242,196,065円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11（適格機関投資家限定）	189,671,232円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01（適格機関投資家限定）	194,513,176円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03（適格機関投資家限定）	204,288,097円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05（適格機関投資家限定）	210,891,605円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07（適格機関投資家限定）	216,419,132円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09（適格機関投資家限定）	217,892,602円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11（適格機関投資家限定）	217,968,562円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01（適格機関投資家限定）	217,965,620円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03（適格機関投資家限定）	217,955,990円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05（適格機関投資家限定）	217,964,659円
合計	7,584,764,545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。	366,648,442円
3. 受益権の総数	7,584,764,545口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年 9月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[2024年 9月25日現在]

--	--	--	--	--

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカドル	7,121,795,390	—	7,006,607,662	115,187,728
合計		7,121,795,390	—	7,006,607,662	115,187,728

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（1口当たり情報）

	[2024年 9月25日現在]
1口当たり純資産額	0.9517円
(1万口当たり純資産額)	(9,517円)

4【委託会社等の概況】

（１）【資本金の額】

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年間における資本金の額の増減はありません。

（２）【事業の内容及び営業の状況】

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

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）【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。

5【委託会社等の経理状況】

(1) 財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱UFJ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		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,626,775	1,626,775	84,700,707
当期変動額			
剰余金の配当			△6,075,125
当期純利益			10,342,327
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	△954,495	△954,495	△954,495
当期変動額合計	△954,495	△954,495	3,312,705
当期末残高	672,279	672,279	88,013,413

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つのグループिंग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)	5,006,309 千円	未払手数料	886,173 千円
						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
おりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第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

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。

独立監査人の中間監査報告書

2024年11月27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
業務執行社員 公認会計士 久保 直毅指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 西郷 篤**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）の2024年3月26日から2024年9月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）の2024年9月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年3月26日から2024年9月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2024年11月27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**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）の2024年3月26日から2024年9月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）の2024年9月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年3月26日から2024年9月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2024年11月27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**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）の2024年3月26日から2024年9月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）の2024年9月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年3月26日から2024年9月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

三菱UFJアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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