

| | |
|--------------------------------------|--|
| 【表紙】 | |
| 【提出書類】 | 有価証券届出書の訂正届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長 |
| 【提出日】 | 平成22年9月13日 |
| 【発行者名】 | 三菱UFJ投信株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 取締役社長 後藤 俊夫 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都千代田区丸の内一丁目4番5号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 荻久保 育子 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目4番5号 |
| 【電話番号】 | 03-6250-4740 |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】 | 三菱UFJ MV20 三菱UFJ MV40 三菱UFJ MV80 (以上を総称として「三菱UFJ MV」といいます。) |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】 | 継続募集額 各ファンドにつき、上限1兆円 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当ありません |

【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日付で半期報告書を提出致しましたので、平成22年3月12日に届出済みの有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、提出するものです。

【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部__は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書が更新されます。また、<追加>の記載事項は原届出書に追加されます。

第二部【ファンド情報】**第1【ファンドの状況】****1【ファンドの性格】****(1)【ファンドの目的及び基本的性格】****<ラッセルの運用体制>****<更新後>**

三菱UFJ MVの各ファンドは株式や公社債等に直接投資するのではなく、ラッセルが設定・運用する投資信託証券を主要投資対象としています。

ラッセルは、インベストメント・マネジメント&リサーチ部が所管する、IM&R Tokyo ポリシー&プロシージャー（社内規程）に基づき、ファンドの運用体制を構築しています。

ラッセルの投資意思決定は、各投資信託証券の主要投資対象である各マザーファンドで採用する運用会社の採用・変更、目標配分割合の設定・変更、運用ガイドラインの作成・変更が中心となります。

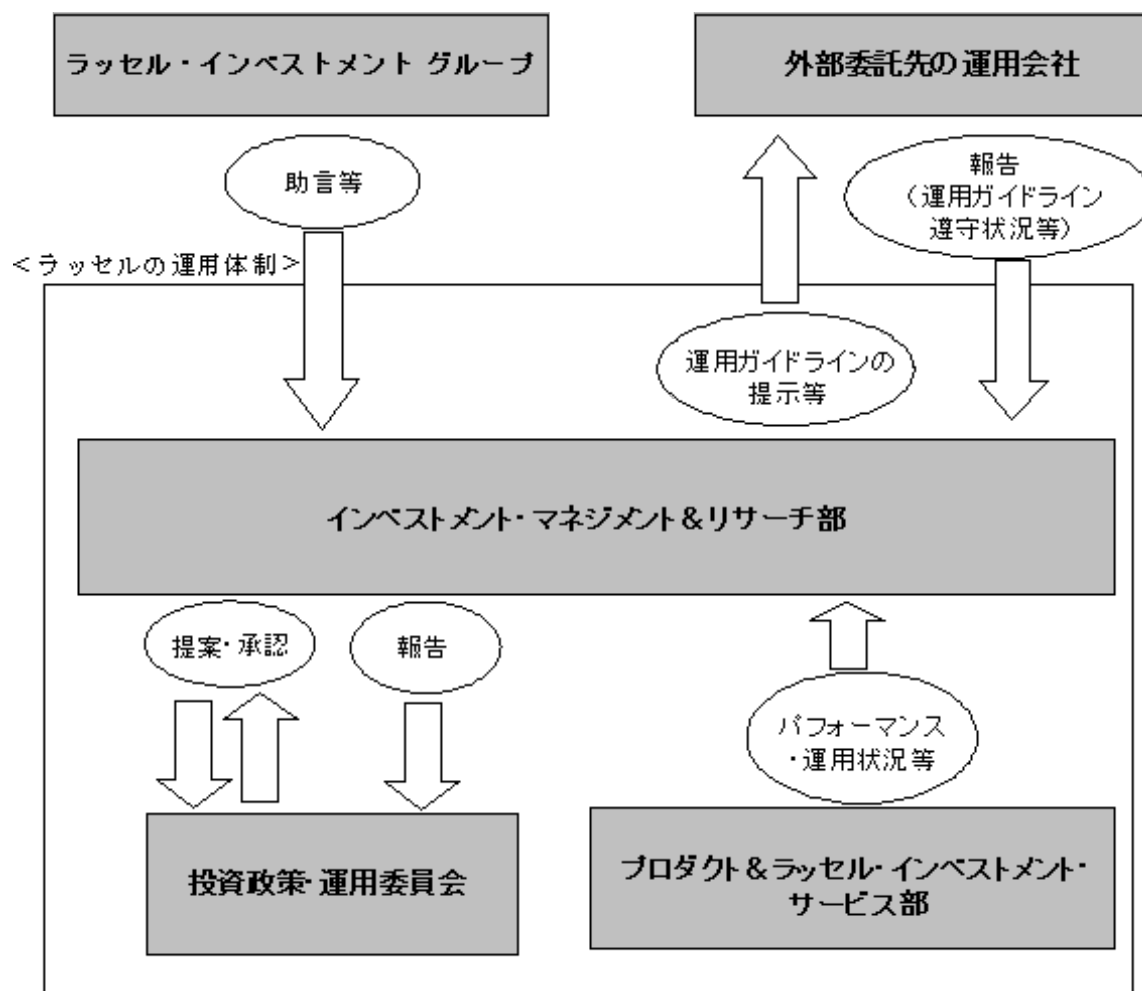
インベストメント・マネジメント&リサーチ部は、ラッセルが属するラッセル・インベストメントグループからの助言等に基づき、運用会社の採用・変更や各運用会社への目標配分割合の設定・変更等に関して投資政策・運用委員会（後述）に提案し、その承認を得ます。ただし、目標配分割合の変更に關しては、ラッセル・インベストメントグループに一定の基準に基づき委託がなされており、投資政策・運用委員会はそのモニタリングを行います。

プロダクト&ラッセル・インベストメント・サービス部は、各投資信託証券および運用会社のパフォーマンス・運用状況等の報告をインベストメント・マネジメント&リサーチ部に行います。

(投資政策・運用委員会)

投資政策・運用委員会は代表取締役社長兼CEO、インベストメント・マネジメント&リサーチ部長およびジェネラル・カウンセルを含む議決権を有する5名の委員と、議決権を有しない準委員から構成されています。

投資政策・運用委員会規程に基づき、原則月に一度、資産評価・運用状況、運用会社のガイドライン遵守状況等のモニタリングについて、報告およびその検証を行っています。



上記体制は、今後変更される場合があります。

(2) 【ファンドの仕組み】

委託会社の概況

<訂正前>

- ・資本金
2,000百万円（平成22年1月末現在）
（略）
- ・大株主の状況（平成22年1月末現在）
（略）

<訂正後>

- ・資本金
2,000百万円（平成22年6月末現在）
（略）
- ・大株主の状況（平成22年6月末現在）
（略）

2 【投資方針】

(2) 【投資対象】

<投資信託証券の概要>

<更新後>

ラッセル 日本株式ファンド II（適格機関投資家限定）

（略）

(ファンドに係る費用)

信託報酬

委託会社、販売会社および受託会社の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産

総額に年1.11825% (税抜 年1.065%) の率を乗じて得た額とします。

内訳:委託会社 年0.966% (税抜 年0.92%)、販売会社 年0.021% (税抜 年0.02%)、受託会社
年0.13125% (税抜 年0.125%)

(略)

ラッセル 外国株式ファンド II (適格機関投資家限定)

(略)

(ファンドに係る費用)

信託報酬

委託会社、販売会社および受託会社の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産
総額に年1.11825% (税抜 年1.065%) の率を乗じて得た額とします。

内訳:委託会社 年0.966% (税抜 年0.92%)、販売会社 年0.021% (税抜 年0.02%)、受託会社
年0.13125% (税抜 年0.125%)

(略)

ラッセル 日本債券ファンド II (適格機関投資家限定)

(略)

(ファンドに係る費用)

信託報酬

委託会社、販売会社および受託会社の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産
総額に年0.546% (税抜 年0.52%) の率を乗じて得た額とします。

内訳:委託会社 年0.42% (税抜 年0.4%)、販売会社 年0.021% (税抜 年0.02%)、受託会社 年
0.105% (税抜 年0.1%)

(略)

ラッセル 外国債券ファンド II Aコース (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)

ラッセル 外国債券ファンド II Bコース (為替ヘッジなし) (適格機関投資家限定)

(略)

(運用方法)

(略)

外国為替予約取引の指図に係る権限の委託先

ラッセル・インプリメンテーション・サービシーズ・インク (ラッセル 外国債券ファンド II A
コース (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定))

(ファンドに係る費用)

信託報酬

委託会社、販売会社および受託会社の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産
総額に 年 0.8925% (税抜 年0.85%) の率を乗じて得た額とします。

内訳:委託会社 年0.7665% (税抜 年0.73%)、販売会社 年0.021% (税抜 年0.02%)、受託会社
年0.105% (税抜 年0.1%)

(略)

各投資信託証券が投資対象とするマザーファンド受益証券の概要

1 ラッセル 日本株式マザーファンド受益証券

株式などの組入れにあたってはフル・インベストメントを基本とします。

わが国の株式を主要投資対象とし、分散投資を行い、信託財産の長期的成長を目指します。

株式以外の資産への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

TOPIX (配当込み) をベンチマークとします。

「マルチ・スタイル、マルチ・マネージャー」のアプローチを採用し、グロース (成長) 型、バ
リュウ (割安) 型、マーケット・オリエンテッド型などに代表される複数の運用スタイルを組み合
わせて運用します。各々の運用スタイルで優れた運用会社を採用することによって、ひとつのファン
ドで運用スタイル分散を行います。なお、ファンド全体としてより適切なポートフォリオを構築する
こと、ファンドの運用または執行をより効率的に行うこと等を目的として、ラッセル・インベストメ
ント グループに属する運用会社にファンドの運用を委託することがあります。

運用権限の委託先（平成22年8月25日現在）

| 委託内容 | 運用会社 |
|----------------------|---|
| グロース（成長）型株式に重点をおいた運用 | ベイビュー・アセット・マネジメント株式会社（日本） |
| バリュー（割安）型株式に重点をおいた運用 | ゼブラ・キャピタル・マネジメント・エル・エル・シー（米国） |
| | アライアンス・バーンスタイン株式会社（日本） アライアンス・バーンスタイン・香港・リミテッド（香港） |
| マーケット・オリエンテッド型の運用 | ファンネックス・アセット・マネジメント株式会社（日本） |
| 後記（注1）をご覧ください | フランク・ラッセル・カンパニー（注2）（米国） |

2 ラッセル 外国株式マザーファンド受益証券

株式などの組入れにあたってはフル・インベストメントを基本とします。

日本を除く世界先進各国の株式を主要投資対象とし、分散投資を行い、信託財産の長期的成長を目指します。

M S C I K O K U S A I（配当込み）をベンチマークとします。

「マルチ・スタイル、マルチ・マネージャー」のアプローチを採用し、グロース（成長）型、バリュー（割安）型、マーケット・オリエンテッド型などに代表される複数の運用スタイルを組み合わせて運用されます。各々の運用スタイルで優れた運用会社を採用することによって、ひとつのファンドで運用スタイル分散を行います。なお、ファンド全体としてより適切なポートフォリオを構築すること、ファンドの運用または執行をより効率的に行うこと等を目的として、ラッセル・インベストメントグループに属する運用会社にファンドの運用を委託することがあります。

運用権限の委託先（平成22年8月25日現在）

| 委託内容 | 運用会社 |
|-----------------------------|-------------------------------------|
| 外国株式を対象としたマーケット・オリエンテッド型の運用 | アローストリート・キャピタル・リミテッド・パートナーシップ（米国） |
| | エムエフエス・インスティテューショナル・アドバイザーズ・インク（米国） |
| 外国株式を対象としたグロース（成長）型の運用 | マーシコ・キャピタル・マネジメント・エル・エル・シー（米国） |
| | マッキンリー・キャピタル・マネジメント・エル・エル・シー（米国） |
| 外国株式を対象としたバリュー（割安）型の運用 | ハリス・アソシエイツ・エル・ピー（米国） |
| 後記（注1）をご覧ください | フランク・ラッセル・カンパニー（注2）（米国） |

3 ラッセル 日本債券マザーファンド受益証券

日本の市場において取引される公社債を主要投資対象とし、分散投資を行い、信託財産の長期的成長を目指します。

N O M U R A - B P I 総合指数をベンチマークとします。

「マルチ・スタイル、マルチ・マネージャー」のアプローチを採用し、収益の主な源泉であるデュレーション調整、満期構成、債券種別選択等から、各運用会社の得意な分野を活かしてこれらに合わせて運用されます。各々の運用スタイルで優れた運用会社を採用することによって、ひとつのファンドで運用スタイル分散を行います。なお、ファンド全体としてより適切なポートフォリオを構築すること、ファンドの運用または執行をより効率的に行うこと等を目的として、ラッセル・インベストメントグループに属する運用会社にファンドの運用を委託することがあります。

運用権限の委託先（平成22年8月25日現在）

| 委託内容 | 運用会社 |
|------------------------|--|
| 国債・事業債および金融債を中心とする債券運用 | D I A Mアセットマネジメント株式会社（日本） 株式会社りそな銀行（日本） |
| 後記（注1）をご覧ください | フランク・ラッセル・カンパニー（注2）（米国） |

4 ラッセル 外国債券マザーファンド受益証券

日本を除く世界先進各国の市場において取引される公社債を主要投資対象とし、分散投資を行い、信託財産の長期的成長を目指します。

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとします。

「マルチ・スタイル、マルチ・マネージャー」のアプローチを採用し、収益の主な源泉であるデュレーション調整、満期構成、国別配分、通貨配分、債券種別選択等から、各運用会社の得意な分野を活かしてこれらを組み合わせて運用されます。各々の運用スタイルで優れた運用会社を採用することによって、ひとつのファンドで運用スタイル分散を行います。なお、ファンド全体としてより適切なポートフォリオを構築すること、ファンドの運用または執行をより効率的に行うこと等を目的として、ラッセル・インベストメント グループに属する運用会社にファンドの運用を委託することがあります。

運用権限の委託先（平成22年8月25日現在）

| 委託内容 | 運用会社 |
|-------------------------------------|--|
| 格付けの高い国の国債（またはこれに準ずる債券）への投資を中心とした運用 | コルチェスター・グローバル・インベスターズ・リミテッド（英国） |
| 国債とともに一般債にも重点をおいた債券運用 | パシフィック・インベストメント・マネージメント・カンパニー・エル・エル・シー（米国） |
| 後記（注1）をご覧ください | フランク・ラッセル・カンパニー（注2）（米国） |

（注1）委託内容

- ・ラッセル 日本株式マザーファンド受益証券とラッセル 外国株式マザーファンド受益証券については、キャッシュ・エクイタイゼーション（流動資金の株式化）- 即ち、運用資産の内、流動資金を株式先物インデックスで運用することにより、ファンドを株式に対してフル・エクスポージャーにし、運用効率を高める。
- ・他の運用会社の運用を補完して信託財産全体に係る適切なポートフォリオを実現することを目的とした、他の運用会社の運用に係る部分以外の信託財産の一部についての運用。
- ・運用会社の変更に際しての、必要に応じた資産の移転管理および一時的な運用。
- ・ラッセルが必要と判断した場合における、信託財産の一部についての運用（他の運用会社からの投資助言等に基づく運用を含む。）。（平成22年9月14日付で追加されます。）

（注2）平成22年9月14日付で「ラッセル・インプリメンテーション・サービシーズ・インク」に変更します。

（3）【運用体制】

<訂正前>

（略）

ファンドの運用体制等は平成22年3月13日現在のものであり、今後変更される可能性があります。

<訂正後>

（略）

ファンドの運用体制等は平成22年9月14日現在のものであり、今後変更される可能性があります。

3【投資リスク】

（2）投資リスクに対する管理体制

〔投資信託証券の設定・運用を行うラッセルの投資リスクに関する管理体制〕

<更新後>

運用リスク管理は（1）外部委託先の運用会社の段階での管理、（2）ファンド全体での管理の2

段階にわたって行われます。

運用会社段階での管理は、インベストメント・マネジメント&リサーチ部が所管する、I M & R Tokyo ポリシー&プロシージャー（社内規程）に基づき、管理しています。ラッセルは、ラッセル・インベストメント グループの協力を得て、各運用会社の運用ガイドライン等の遵守状況をモニタリングしています（グループ会社に対しても、必要な監督を行っています。）。運用ガイドラインは運用会社に対する運用の詳細を定めたもので、ベンチマークや目標リターン、運用スタイルといった運用の性格を記述するとともに、業種別のベンチマーク比乖離の上限、投資可能証券の範囲等を定めています。運用会社は運用ガイドラインに違反した場合には直ちにラッセル・インベストメント グループに報告する義務があります。また、ラッセルは定期的に各運用会社から違反がなかった旨の確認をとっており、その結果がインベストメント・マネジメント&リサーチ部から、投資政策・運用委員会に報告されます。

ファンド全体での管理はインベストメント・オペレーション部の協力を得て、法務・コンプライアンス部がその実施状況の確認をしています。チェック項目は主として法令等の遵守状況です。また、法務・コンプライアンス部は定期的に運用会社から法令遵守状況の確認をとっています。

（略）

5【運用状況】

<更新後>

「三菱UFJ MV20」

(1)【投資状況】

平成22年6月30日現在

(単位：円)

| 資産の種類 | 国/地域名 | 時価合計 | 投資比率(%) |
|--------------------------|-------|---------------|---------|
| 投資信託受益証券 | 日本 | 5,165,956,648 | 99.04 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | | 50,161,763 | 0.96 |
| 純資産総額 | | 5,216,118,411 | 100.00 |

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

平成22年6月30日現在

| 国/地域 | 銘柄 | 種類 | 業種 | 口数 (口) | 上段：帳簿価額 下段：評価額 | | 利率(%) 償還期限 (年/月/日) | 投資 比率 (%) |
|------|---|--------------|----|---------------|-------------------|--------------------------------|--------------------------|-----------------|
| | | | | | 単価(円) | 金額(円) | | |
| 日本 | ラッセル 日本債券ファンド (適格機関投資家限定) | 投資信託 受益証券 | | 1,801,205,003 | 1.1072 1.1346 | 1,994,468,896 2,043,647,196 | | 39.18 |
| 日本 | ラッセル 外国債券ファンド Aコース(為替ヘッジあり)(適 格機関投資家限定) | 投資信託 受益証券 | | 1,471,136,413 | 1.1851 1.2541 | 1,743,583,521 1,844,952,175 | | 35.37 |
| 日本 | ラッセル 日本株式ファンド (適格機関投資家限定) | 投資信託 受益証券 | | 930,071,838 | 0.8610 0.8287 | 800,852,824 770,750,532 | | 14.78 |
| 日本 | ラッセル 外国債券ファンド Bコース(為替ヘッジなし)(適 格機関投資家限定) | 投資信託 受益証券 | | 163,979,115 | 1.6300 1.5634 | 267,297,435 256,364,948 | | 4.91 |
| 日本 | ラッセル 外国株式ファンド (適格機関投資家限定) | 投資信託 受益証券 | | 303,654,650 | 0.8877 0.8241 | 269,571,079 250,241,797 | | 4.80 |

(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

平成22年6月30日現在

| 種類/業種別 | 投資比率(%) |
|----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 99.04 |
| 合計 | 99.04 |

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成22年6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) |
|---------------------------|----------------------|------------------------|
| 第1計算期間末日 (平成13年12月12日) | 25,615,422,469 (分配付) | 9,828 (分配付) |
| | 25,615,422,469 (分配落) | 9,828 (分配落) |
| 第2計算期間末日 (平成14年12月12日) | 25,053,285,644 (分配付) | 9,744 (分配付) |
| | 25,053,285,644 (分配落) | 9,744 (分配落) |
| 第3計算期間末日 (平成15年12月12日) | 22,573,147,925 (分配付) | 10,091 (分配付) |
| | 22,380,772,012 (分配落) | 10,005 (分配落) |
| 第4計算期間末日 (平成16年12月13日) | 19,397,039,013 (分配付) | 10,479 (分配付) |
| | 18,749,155,611 (分配落) | 10,129 (分配落) |
| 第5計算期間末日 (平成17年12月12日) | 11,739,247,647 (分配付) | 10,907 (分配付) |
| | 11,416,361,985 (分配落) | 10,607 (分配落) |

| | | |
|---------------------------|--|------------------------------|
| 第6計算期間末日 (平成18年12月12日) | 9,178,061,823 (分配付) 9,178,061,823 (分配落) | 10,631 (分配付) 10,631 (分配落) |
| 第7計算期間末日 (平成19年12月12日) | 7,822,290,447 (分配付) 7,822,290,447 (分配落) | 10,501 (分配付) 10,501 (分配落) |
| 第8計算期間末日 (平成20年12月12日) | 5,811,746,403 (分配付) 5,811,746,403 (分配落) | 9,214 (分配付) 9,214 (分配落) |
| 第9計算期間末日 (平成21年12月14日) | 5,669,321,448 (分配付) 5,669,321,448 (分配落) | 10,004 (分配付) 10,004 (分配落) |
| 平成21年 6月末日 | 5,899,974,672 | 9,724 |
| 7月末日 | 5,932,078,625 | 9,853 |
| 8月末日 | 5,998,743,887 | 10,024 |
| 9月末日 | 5,899,470,414 | 9,983 |
| 10月末日 | 5,773,746,922 | 9,944 |
| 11月末日 | 5,640,342,823 | 9,870 |
| 12月末日 | 5,654,039,058 | 10,080 |
| 平成22年 1月末日 | 5,608,718,511 | 10,084 |
| 2月末日 | 5,534,191,488 | 10,066 |
| 3月末日 | 5,494,178,786 | 10,296 |
| 4月末日 | 5,450,147,315 | 10,386 |
| 5月末日 | 5,295,743,242 | 10,184 |
| 6月末日 | 5,216,118,411 | 10,176 |

【分配の推移】

| | 1万口当たりの分配金 |
|--------|------------|
| 第1計算期間 | 0円 |
| 第2計算期間 | 0円 |
| 第3計算期間 | 86円 |
| 第4計算期間 | 350円 |
| 第5計算期間 | 300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 |

【収益率の推移】

| | 収益率(%) |
|------------------------------|--------|
| 第1計算期間 | 1.72 |
| 第2計算期間 | 0.85 |
| 第3計算期間 | 3.56 |
| 第4計算期間 | 4.73 |
| 第5計算期間 | 7.68 |
| 第6計算期間 | 0.22 |
| 第7計算期間 | 1.22 |
| 第8計算期間 | 12.25 |
| 第9計算期間 | 8.57 |
| 第9計算期間末日から 平成22年6月末日までの期間 | 1.71 |

(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(分配落ちの額、以下「前期末基準価額」)を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数。ただし、第9計算期間末日から平成22年6月末日までの期間については平成22年6月末日の基準価額から前期末基準価額を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数。

「三菱UFJ MV40」

(1) 投資状況

平成22年6月30日現在

(単位：円)

| 資産の種類 | 国/地域名 | 時価合計 | 投資比率(%) |
|--------------------------|-------|---------------|---------|
| 投資信託受益証券 | 日本 | 5,262,856,425 | 99.14 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | | 45,436,251 | 0.86 |
| 純資産総額 | | 5,308,292,676 | 100.00 |

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成22年6月30日現在

| 国/地域 | 銘柄 | 種類 | 業種 | 口数 (口) | 上段：帳簿価額 下段：評価額 | | 利率(%) 償還期限 (年/月/日) | 投資 比率 (%) |
|------|---|--------------|----|---------------|-------------------|--------------------------------|--------------------------|-----------------|
| | | | | | 単価(円) | 金額(円) | | |
| 日本 | ラッセル 日本株式ファンド (適格機関投資家限定) | 投資信託 受益証券 | | 1,903,636,213 | 0.8606 0.8287 | 1,638,354,165 1,577,543,329 | | 29.72 |
| 日本 | ラッセル 日本債券ファンド (適格機関投資家限定) | 投資信託 受益証券 | | 1,369,994,506 | 1.1074 1.1346 | 1,517,237,405 1,554,395,766 | | 29.28 |
| 日本 | ラッセル 外国債券ファンド Aコース(為替ヘッジあり)(適 格機関投資家限定) | 投資信託 受益証券 | | 1,079,213,960 | 1.1860 1.2541 | 1,280,016,826 1,353,442,227 | | 25.50 |
| 日本 | ラッセル 外国株式ファンド (適格機関投資家限定) | 投資信託 受益証券 | | 624,225,478 | 0.8884 0.8241 | 554,605,782 514,424,216 | | 9.69 |
| 日本 | ラッセル 外国債券ファンド Bコース(為替ヘッジなし)(適 格機関投資家限定) | 投資信託 受益証券 | | 168,255,653 | 1.6320 1.5634 | 274,599,282 263,050,887 | | 4.96 |

(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

平成22年6月30日現在

| 種類/業種別 | 投資比率(%) |
|----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 99.14 |
| 合計 | 99.14 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

下記計算期間末日および平成22年6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) |
|---------------------------|--|------------------------------|
| 第1計算期間末日 (平成13年12月12日) | 8,947,431,614 (分配付) 8,947,431,614 (分配落) | 9,586 (分配付) 9,586 (分配落) |
| 第2計算期間末日 (平成14年12月12日) | 9,763,593,469 (分配付) 9,763,593,469 (分配落) | 9,115 (分配付) 9,115 (分配落) |
| 第3計算期間末日 (平成15年12月12日) | 9,682,678,316 (分配付) 9,682,678,316 (分配落) | 9,751 (分配付) 9,751 (分配落) |
| 第4計算期間末日 (平成16年12月13日) | 9,121,238,875 (分配付) 8,858,297,432 (分配落) | 10,407 (分配付) 10,107 (分配落) |
| 第5計算期間末日 (平成17年12月12日) | 9,030,882,787 (分配付) 8,646,665,634 (分配落) | 11,752 (分配付) 11,252 (分配落) |
| 第6計算期間末日 (平成18年12月12日) | 9,409,708,615 (分配付) 9,409,708,615 (分配落) | 11,405 (分配付) 11,405 (分配落) |
| 第7計算期間末日 (平成19年12月12日) | 8,057,042,752 (分配付) 8,057,042,752 (分配落) | 11,284 (分配付) 11,284 (分配落) |
| 第8計算期間末日 (平成20年12月12日) | 5,657,656,999 (分配付) 5,657,656,999 (分配落) | 8,645 (分配付) 8,645 (分配落) |
| 第9計算期間末日 (平成21年12月14日) | 5,886,638,493 (分配付) 5,886,638,493 (分配落) | 9,609 (分配付) 9,609 (分配落) |
| 平成21年 6月末日 | 5,989,437,209 | 9,370 |
| 7月末日 | 6,100,459,517 | 9,566 |
| 8月末日 | 6,192,110,468 | 9,755 |
| 9月末日 | 6,038,286,453 | 9,610 |
| 10月末日 | 5,976,257,643 | 9,557 |
| 11月末日 | 5,771,831,258 | 9,325 |
| 12月末日 | 5,964,219,782 | 9,766 |
| 平成22年 1月末日 | 5,814,075,941 | 9,716 |
| 2月末日 | 5,751,560,463 | 9,638 |
| 3月末日 | 5,799,019,515 | 10,071 |
| 4月末日 | 5,771,116,222 | 10,149 |
| 5月末日 | 5,447,252,714 | 9,708 |
| 6月末日 | 5,308,292,676 | 9,613 |

分配の推移

| | 1万口当たりの分配金 |
|--------|------------|
| 第1計算期間 | 0円 |
| 第2計算期間 | 0円 |
| 第3計算期間 | 0円 |
| 第4計算期間 | 300円 |
| 第5計算期間 | 500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 |

収益率の推移

| | 収益率(%) |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 4.14 |
| 第2計算期間 | 4.91 |
| 第3計算期間 | 6.97 |
| 第4計算期間 | 6.72 |
| 第5計算期間 | 16.27 |
| 第6計算期間 | 1.35 |

| | |
|------------------------------|-------|
| 第7計算期間 | 1.06 |
| 第8計算期間 | 23.38 |
| 第9計算期間 | 11.15 |
| 第9計算期間末日から 平成22年6月末日までの期間 | 0.04 |

(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（分配落ちの額、以下「前期末基準価額」）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数。ただし、第9計算期間末日から平成22年6月末日までの期間については平成22年6月末日の基準価額から前期末基準価額を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数。

「三菱UFJ MV80」

(1) 投資状況

平成22年6月30日現在

(単位：円)

| 資産の種類 | 国/地域名 | 時価合計 | 投資比率(%) |
|--------------------------|-------|---------------|---------|
| 投資信託受益証券 | 日本 | 3,422,196,836 | 99.23 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | | 26,542,011 | 0.77 |
| 純資産総額 | | 3,448,738,847 | 100.00 |

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成22年6月30日現在

| 国/ 地域 | 銘柄 | 種類 | 業種 | 口数 (口) | 上段：帳簿価額 下段：評価額 | | 利率(%) 償還期限 (年/月/日) | 投資 比率 (%) |
|----------|---|--------------|----|---------------|-------------------|--------------------------------|--------------------------|-----------------|
| | | | | | 単価(円) | 金額(円) | | |
| 日本 | ラッセル 日本株式ファンド (適格機関投資家限定) | 投資信託 受益証券 | | 2,296,303,484 | 0.8613 0.8287 | 1,977,837,391 1,902,946,697 | | 55.18 |
| 日本 | ラッセル 外国株式ファンド (適格機関投資家限定) | 投資信託 受益証券 | | 1,031,974,090 | 0.8883 0.8241 | 916,754,828 850,449,847 | | 24.66 |
| 日本 | ラッセル 日本債券ファンド (適格機関投資家限定) | 投資信託 受益証券 | | 279,272,356 | 1.1078 1.1346 | 309,403,888 316,862,415 | | 9.19 |
| 日本 | ラッセル 外国債券ファンド Aコース(為替ヘッジあり)(適 格機関投資家限定) | 投資信託 受益証券 | | 143,616,849 | 1.1877 1.2541 | 170,574,496 180,109,890 | | 5.22 |
| 日本 | ラッセル 外国債券ファンド Bコース(為替ヘッジなし)(適 格機関投資家限定) | 投資信託 受益証券 | | 109,906,606 | 1.6338 1.5634 | 179,565,962 171,827,987 | | 4.98 |

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

b 全銘柄の種類/業種別投資比率

平成22年6月30日現在

| 種類/業種別 | 投資比率(%) |
|----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 99.23 |
| 合計 | 99.23 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

下記計算期間末日および平成22年6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) |
|---------------------------|--|------------------------------|
| 第1計算期間末日 (平成13年12月12日) | 3,822,633,173 (分配付) 3,822,633,173 (分配落) | 9,133 (分配付) 9,133 (分配落) |
| 第2計算期間末日 (平成14年12月12日) | 4,175,467,084 (分配付) 4,175,467,084 (分配落) | 7,945 (分配付) 7,945 (分配落) |
| 第3計算期間末日 (平成15年12月12日) | 4,951,829,000 (分配付) 4,951,829,000 (分配落) | 8,968 (分配付) 8,968 (分配落) |
| 第4計算期間末日 (平成16年12月13日) | 5,263,405,279 (分配付) 5,236,853,905 (分配落) | 9,912 (分配付) 9,862 (分配落) |
| 第5計算期間末日 (平成17年12月12日) | 5,869,110,551 (分配付) 5,647,048,368 (分配落) | 13,215 (分配付) 12,715 (分配落) |
| 第6計算期間末日 (平成18年12月12日) | 6,180,850,514 (分配付) 6,134,072,602 (分配落) | 13,213 (分配付) 13,113 (分配落) |
| 第7計算期間末日 (平成19年12月12日) | 5,628,581,696 (分配付) 5,628,581,696 (分配落) | 13,012 (分配付) 13,012 (分配落) |
| 第8計算期間末日 (平成20年12月12日) | 3,129,066,949 (分配付) 3,129,066,949 (分配落) | 7,375 (分配付) 7,375 (分配落) |
| 第9計算期間末日 (平成21年12月14日) | 3,619,111,001 (分配付) 3,619,111,001 (分配落) | 8,633 (分配付) 8,633 (分配落) |
| 平成21年 6月末日 | 3,601,704,322 | 8,420 |
| 7月末日 | 3,735,268,369 | 8,741 |
| 8月末日 | 3,829,683,246 | 8,951 |
| 9月末日 | 3,705,723,325 | 8,661 |
| 10月末日 | 3,657,127,286 | 8,606 |
| 11月末日 | 3,430,853,177 | 8,133 |
| 12月末日 | 3,732,534,085 | 8,930 |
| 平成22年 1月末日 | 3,655,981,932 | 8,754 |
| 2月末日 | 3,584,966,239 | 8,588 |
| 3月末日 | 3,894,013,147 | 9,356 |
| 4月末日 | 3,921,116,597 | 9,423 |
| 5月末日 | 3,554,940,417 | 8,544 |
| 6月末日 | 3,448,738,847 | 8,295 |

分配の推移

| | 1万口当たりの分配金 |
|--------|------------|
| 第1計算期間 | 0円 |
| 第2計算期間 | 0円 |
| 第3計算期間 | 0円 |
| 第4計算期間 | 50円 |
| 第5計算期間 | 500円 |
| 第6計算期間 | 100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 |

収益率の推移

| | 収益率（％） |
|------------------------------|--------|
| 第1計算期間 | 8.67 |
| 第2計算期間 | 13.00 |
| 第3計算期間 | 12.87 |
| 第4計算期間 | 10.52 |
| 第5計算期間 | 33.99 |
| 第6計算期間 | 3.91 |
| 第7計算期間 | 0.77 |
| 第8計算期間 | 43.32 |
| 第9計算期間 | 17.05 |
| 第9計算期間末日から 平成22年6月末日までの期間 | 3.91 |

（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（分配落ちの額、以下「前期末基準価額」）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数。ただし、第9計算期間末日から平成22年6月末日までの期間については平成22年6月末日の基準価額から前期末基準価額を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数。

[次へ](#)

(参考情報)

『三菱UFJ MV20』、『三菱UFJ MV40』及び『三菱UFJ MV80』の各ファンドは、ラッセルの設定・運用する追加型証券投資信託「ラッセル日本株式ファンド(適格機関投資家限定)」、「ラッセル外国株式ファンド(適格機関投資家限定)」、「ラッセル日本債券ファンド(適格機関投資家限定)」、「ラッセル外国債券ファンド Aコース(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)」及び「ラッセル外国債券ファンド Bコース(為替ヘッジなし)(適格機関投資家限定)」の各ファンドを投資対象としております。

なお、同各ファンドの全体の投資状況は以下のとおりであります。

ラッセル日本株式ファンド(適格機関投資家限定)の投資状況

(2010年6月30日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|----|---------------|-------------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 9,535,054,779 | 100.06 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 5,737,904 | 0.06 |
| 合計(純資産総額) | - | 9,529,316,875 | 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比率をいいます。

ラッセル外国株式ファンド(適格機関投資家限定)の投資状況

(2010年6月30日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|----|---------------|-------------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 3,675,101,387 | 100.06 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 2,270,724 | 0.06 |
| 合計(純資産総額) | - | 3,672,830,663 | 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比率をいいます。

ラッセル日本債券ファンド(適格機関投資家限定)の投資状況

(2010年6月30日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|----|---------------|-------------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 3,922,581,766 | 100.03 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 1,120,656 | 0.03 |
| 合計(純資産総額) | - | 3,921,461,110 | 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比率をいいます。

ラッセル外国債券ファンド Aコース(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)の投資状況

(2010年6月30日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|----|---------------|-------------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 3,267,960,608 | 96.73 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 110,623,857 | 3.27 |
| 合計(純資産総額) | - | 3,378,584,465 | 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比率をいいます。

ラッセル外国債券ファンド Bコース(為替ヘッジなし)(適格機関投資家限定)の投資状況

(2010年6月30日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|----|-------------|-------------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 691,557,350 | 100.05 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 329,118 | 0.05 |
| 合計(純資産総額) | - | 691,228,232 | 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比率をいいます。

(ご参考)

また、前記ラッセルの設定・運用する各ファンドは、同じく同社の設定・運用する親投資信託「ラッセル日本株式マザーファンド」、「ラッセル外国株式マザーファンド」、「ラッセル日本債券マザーファンド」及び「ラッセル外国債券マザーファンド」の各受益証券を投資対象としており、前頁表中における「親投資信託受益証券」は全て同各マザーファンドの受益証券であります。

なお、同各マザーファンドの全体の投資状況は以下のとおりであります。

ラッセル日本株式マザーファンドの投資状況

(2010年6月30日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|----|----------------|-------------|
| 株式 | 日本 | 47,091,522,600 | 93.61 |
| 投資証券 | 日本 | 21,960,000 | 0.04 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 3,194,160,058 | 6.35 |
| 合計(純資産総額) | - | 50,307,642,658 | 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比率をいいます。

その他の資産の投資状況

(2010年6月30日現在)

| 資産の種類 | 買建/売建 | 地域 | 評価額 (円) | 投資比率 (%) |
|----------|-------|----|---------------|-------------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | 日本 | 3,127,605,000 | 6.22 |

(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比率をいいます。

ラッセル外国株式マザーファンドの投資状況

(2010年6月30日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|-------|---------|----------------|-------------|
| 株式 | アメリカ | 15,596,807,925 | 42.02 |
| | カナダ | 427,632,660 | 1.15 |
| | ドイツ | 1,850,016,132 | 4.98 |
| | イタリア | 138,415,878 | 0.37 |
| | フランス | 2,170,693,656 | 5.85 |
| | オーストラリア | 47,844,139 | 0.13 |
| | イギリス | 3,032,375,463 | 8.17 |
| | スイス | 3,540,723,331 | 9.54 |
| | パミューダ | 113,601,946 | 0.31 |
| | 香港 | 342,993,274 | 0.92 |
| | シンガポール | 146,704,449 | 0.40 |
| | オランダ | 1,767,436,910 | 4.76 |
| | スペイン | 571,576,141 | 1.54 |
| | ベルギー | 242,601,858 | 0.65 |
| | スウェーデン | 1,007,845,423 | 2.72 |
| | ノルウェー | 24,772,526 | 0.07 |
| | オーストリア | 86,016,460 | 0.23 |
| | ルクセンブルク | 109,677,458 | 0.30 |
| | フィンランド | 449,108,017 | 1.21 |
| | デンマーク | 184,796,630 | 0.50 |
| | インドネシア | 64,046,565 | 0.17 |
| | メキシコ | 202,742,894 | 0.55 |
| | ブラジル | 602,872,096 | 1.62 |
| | 韓国 | 317,191,680 | 0.85 |
| | アイルランド | 224,643,508 | 0.61 |
| | インド | 127,542,027 | 0.34 |
| | チェコ | 36,015,000 | 0.10 |
| | イスラエル | 45,531,984 | 0.12 |
| | ポルトガル | 48,441,206 | 0.13 |
| | ロシア | 70,882,890 | 0.19 |
| | 中国 | 114,602,778 | 0.31 |
| | ケイマン島 | 325,986,636 | 0.88 |

| | | | |
|---------------------|-------|----------------|--------|
| | パナマ | 198,408,967 | 0.53 |
| | ジャージー | 385,213,470 | 1.04 |
| | 小計 | 34,615,761,977 | 93.27 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 2,498,250,535 | 6.73 |
| 合計(純資産総額) | - | 37,114,012,512 | 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比率をいいます。

その他の資産の投資状況

(2010年6月30日現在)

| 資産の種類 | 買建/売建 | 地域 | 評価額 (円) | 投資比率 (%) |
|----------|-------|---------|---------------|-------------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 1,328,248,488 | 3.58 |
| | | ドイツ | 413,828,685 | 1.12 |
| | | イギリス | 260,684,130 | 0.70 |
| | | カナダ | 142,730,390 | 0.38 |
| | | オーストラリア | 105,851,538 | 0.29 |
| | | スイス | 100,127,434 | 0.27 |
| | | 香港 | 45,905,238 | 0.12 |

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

ラッセル日本債券マザーファンドの投資状況

(2010年6月30日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|------|----------------|-------------|
| 新株予約権付社債券等 | 日本 | 1,343,282,000 | 8.87 |
| 国債証券 | 日本 | 9,383,020,665 | 61.98 |
| 特殊債券 | 日本 | 100,717,000 | 0.67 |
| 社債券 | 日本 | 3,663,634,000 | 24.20 |
| | フランス | 300,583,000 | 1.99 |
| | 小計 | 3,964,217,000 | 26.19 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 346,869,822 | 2.29 |
| 合計(純資産総額) | - | 15,138,106,487 | 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比率をいいます。

その他の資産の投資状況

(2010年6月30日現在)

| 資産の種類 | 買建/売建 | 地域 | 評価額 (円) | 投資比率 (%) |
|--------|-------|----|-------------|-------------|
| 債券先物取引 | 買建 | 日本 | 127,413,000 | 0.84 |

(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比率をいいます。

ラッセル外国債券マザーファンドの投資状況

(2010年6月30日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|-----------|---------------------|----------------|---------------|
| 国債証券 | アメリカ | 1,375,398,056 | 9.82 |
| | カナダ | 162,429,318 | 1.16 |
| | ドイツ | 2,571,774,901 | 18.36 |
| | イタリア | 284,618,841 | 2.03 |
| | フランス | 99,386,740 | 0.71 |
| | オーストラリア | 73,441,033 | 0.52 |
| | イギリス | 167,503,725 | 1.20 |
| | ニュージーランド | 566,444,601 | 4.04 |
| | オランダ | 90,169,092 | 0.64 |
| | デンマーク | 52,750,587 | 0.38 |
| | メキシコ | 448,983,649 | 3.21 |
| | ブラジル | 293,142,270 | 2.09 |
| | 韓国 | 186,064,385 | 1.33 |
| | アイルランド | 296,609,587 | 2.12 |
| | チェコ | 69,882,084 | 0.50 |
| | ポーランド | 391,314,010 | 2.79 |
| | 南アフリカ | 33,203,323 | 0.24 |
| | スロバキア | 15,556,770 | 0.11 |
| | 小計 | 7,178,672,972 | 51.26 |
| 地方債証券 | アメリカ | 9,211,121 | 0.07 |
| | カナダ | 203,031,391 | 1.45 |
| | 小計 | 212,242,512 | 1.52 |
| 特殊債券 | アメリカ | 390,461,330 | 2.79 |
| | ドイツ | 489,684,434 | 3.50 |
| | フランス | 59,076,800 | 0.42 |
| | オーストラリア | 137,011,284 | 0.98 |
| | オランダ | 17,923,747 | 0.13 |
| | スペイン | 35,426,160 | 0.25 |
| | スウェーデン | 36,690,532 | 0.26 |
| | 韓国 | 71,907,828 | 0.51 |
| | 国際機関 | 248,221,647 | 1.77 |
| | 小計 | 1,486,403,762 | 10.61 |
| 社債券 | アメリカ | 418,935,262 | 2.99 |
| | カナダ | 287,352,425 | 2.05 |
| | フランス | 638,133,708 | 4.56 |
| | オーストラリア | 1,012,376,651 | 7.23 |
| | イギリス | 594,000,962 | 4.24 |
| | オランダ | 1,028,772,388 | 7.35 |
| | スウェーデン | 32,781,571 | 0.23 |
| | ノルウェー | 22,174,360 | 0.16 |
| | デンマーク | 29,282,649 | 0.21 |
| | チャネル諸島 | 3,737,602 | 0.03 |
| | 小計 | 4,067,547,578 | 29.04 |
| | 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 1,059,572,562 |
| 合計(純資産総額) | - | 14,004,439,386 | 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比率をいいます。

その他の資産の投資状況

(2010年6月30日現在)

| 資産の種類 | 買建/売建 | 地域 | 評価額 (円) | 投資比率 (%) |
|---------|-------|---------|---------------|-------------|
| 債券先物取引 | 買建 | アメリカ | 1,431,040,964 | 10.22 |
| | | オーストラリア | 428,500,322 | 3.06 |
| | | ドイツ | 404,661,600 | 2.89 |
| | | イギリス | 256,942,201 | 1.83 |
| | | カナダ | 62,131,492 | 0.44 |
| 金利先物取引 | 買建 | イギリス | 4,367,388,490 | 31.19 |
| 債券オプション | 売建 | アメリカ | 77,423 | 0.00 |

(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比率をいいます。

(注)オプションの評価額は、プレミアムの金額を表示しております。

[次へ](#)

(参考情報)

『三菱UFJ MV20』、『三菱UFJ MV40』及び『三菱UFJ MV80』の各ファンドは、ラッセルの設定・運用する追加型証券投資信託「ラッセル日本株式ファンド(適格機関投資家限定)」、「ラッセル外国株式ファンド(適格機関投資家限定)」、「ラッセル日本債券ファンド(適格機関投資家限定)」、「ラッセル外国債券ファンド Aコース(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)」及び「ラッセル外国債券ファンド Bコース(為替ヘッジなし)(適格機関投資家限定)」の各ファンドを投資対象としております。

なお、同各ファンドの投資資産は次のとおりであります。

投資有価証券の主要銘柄

ラッセル日本株式ファンド(適格機関投資家限定)

(2010年6月30日現在)

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額 単価 (円) | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------|---------------|----------------------|----------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 日本 | 親投資信託 受益証券 | ラッセル 日本株 式マザーファンド | 10,769,205,760 | 0.9247 | 9,958,987,637 | 0.8854 | 9,535,054,779 | 100.06 |

投資有価証券種類別投資比率

(2010年6月30日現在)

| 国内/外国 | 種類 | 投資比率(%) |
|-------|-----------|---------|
| 国内 | 親投資信託受益証券 | 100.06 |
| | 合計 | 100.06 |

ラッセル外国株式ファンド(適格機関投資家限定)

(2010年6月30日現在)

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額 単価 (円) | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------|---------------|----------------------|---------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 日本 | 親投資信託 受益証券 | ラッセル 外国株 式マザーファンド | 4,424,634,466 | 0.8857 | 3,919,052,639 | 0.8306 | 3,675,101,387 | 100.06 |

投資有価証券種類別投資比率

(2010年6月30日現在)

| 国内/外国 | 種類 | 投資比率(%) |
|-------|-----------|---------|
| 国内 | 親投資信託受益証券 | 100.06 |
| | 合計 | 100.06 |

ラッセル日本債券ファンド(適格機関投資家限定)

(2010年6月30日現在)

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額 単価 (円) | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------|---------------|----------------------|---------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 日本 | 親投資信託 受益証券 | ラッセル 日本債 券マザーファンド | 3,262,022,259 | 1.1682 | 3,810,694,403 | 1.2025 | 3,922,581,766 | 100.03 |

投資有価証券種類別投資比率

(2010年6月30日現在)

| 国内/外国 | 種類 | 投資比率(%) |
|-------|-----------|---------|
| 国内 | 親投資信託受益証券 | 100.03 |
| | 合計 | 100.03 |

ラッセル外国債券ファンド Aコース(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)

(2010年6月30日現在)

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額 単価 (円) | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------|---------------|----------------------|---------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 日本 | 親投資信託 受益証券 | ラッセル 外国債 券マザーファンド | 1,767,994,270 | 1.9174 | 3,390,024,786 | 1.8484 | 3,267,960,608 | 96.73 |

投資有価証券種類別投資比率

(2010年6月30日現在)

| 国内/外国 | 種類 | 投資比率(%) |
|-------|-----------|---------|
| 国内 | 親投資信託受益証券 | 96.73 |
| | 合計 | 96.73 |

ラッセル外国債券ファンド Bコース(為替ヘッジなし)(適格機関投資家限定)

(2010年6月30日現在)

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額 単価 (円) | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------|---------------|----------------------|-------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 日本 | 親投資信託 受益証券 | ラッセル 外国債 券マザーファンド | 374,138,363 | 1.9191 | 718,008,933 | 1.8484 | 691,557,350 | 100.05 |

投資有価証券種類別投資比率

(2010年6月30日現在)

| 国内/外国 | 種類 | 投資比率(%) |
|-------|-----------|---------|
| 国内 | 親投資信託受益証券 | 100.05 |
| | 合計 | 100.05 |

投資不動産物件

ラッセル日本株式ファンド (適格機関投資家限定)
該当事項はありません。

ラッセル外国株式ファンド (適格機関投資家限定)
該当事項はありません。

ラッセル日本債券ファンド (適格機関投資家限定)
該当事項はありません。

ラッセル外国債券ファンド Aコース(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)
該当事項はありません。

ラッセル外国債券ファンド Bコース(為替ヘッジなし)(適格機関投資家限定)
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

ラッセル日本株式ファンド (適格機関投資家限定)
該当事項はありません。

ラッセル外国株式ファンド (適格機関投資家限定)
該当事項はありません。

ラッセル日本債券ファンド (適格機関投資家限定)
該当事項はありません。

ラッセル外国債券ファンド Aコース(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)
該当事項はありません。

ラッセル外国債券ファンド Bコース(為替ヘッジなし)(適格機関投資家限定)
該当事項はありません。

[前へ](#) [次へ](#)

(ご参考)

また、前記ラッセルの設定・運用する各ファンドは、同じく同社の設定・運用する親投資信託「ラッセル日本株式マザーファンド」、「ラッセル外国株式マザーファンド」、「ラッセル日本債券マザーファンド」及び「ラッセル外国債券マザーファンド」の各受益証券を投資対象にしております。

なお、同各マザーファンドの投資資産は次のとおりであります。

投資有価証券の主要銘柄
ラッセル日本株式マザーファンド

(2010年6月30日現在)

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿価額 単価 (円) | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------|----|-------------------|--------|-----------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 439,100 | 3,159.84 | 1,387,485,744 | 2,538.00 | 1,114,435,800 | 2.22 |
| 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 2,701,000 | 494.40 | 1,335,374,400 | 405.00 | 1,093,905,000 | 2.17 |
| 日本 | 株式 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 305,000 | 3,625.00 | 1,105,625,000 | 3,080.00 | 939,400,000 | 1.87 |
| 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 254,800 | 3,817.75 | 972,764,412 | 3,640.00 | 927,472,000 | 1.84 |
| 日本 | 株式 | 東京電力 | 電気・ガス業 | 350,800 | 2,391.67 | 838,999,138 | 2,411.00 | 845,778,800 | 1.68 |
| 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 313,800 | 3,163.46 | 992,693,748 | 2,597.00 | 814,938,600 | 1.62 |
| 日本 | 株式 | エヌ・ティ・ティ・ドコモ | 情報・通信業 | 5,492 | 148,358.09 | 814,782,664 | 134,500.00 | 738,674,000 | 1.47 |
| 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 390,500 | 2,321.67 | 906,615,674 | 1,864.00 | 727,892,000 | 1.45 |
| 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 188,000 | 3,984.70 | 749,125,461 | 3,820.00 | 718,160,000 | 1.43 |
| 日本 | 株式 | 日産自動車 | 輸送用機器 | 1,136,100 | 758.81 | 862,090,645 | 626.00 | 711,198,600 | 1.41 |
| 日本 | 株式 | 任天堂 | その他製品 | 24,800 | 30,773.21 | 763,175,608 | 26,350.00 | 653,480,000 | 1.30 |
| 日本 | 株式 | オリックス | その他金融業 | 96,360 | 8,061.30 | 776,787,237 | 6,500.00 | 626,340,000 | 1.25 |
| 日本 | 株式 | KDDI | 情報・通信業 | 1,360 | 458,295.04 | 623,281,261 | 424,500.00 | 577,320,000 | 1.15 |
| 日本 | 株式 | 三井物産 | 卸売業 | 544,900 | 1,551.23 | 845,265,227 | 1,054.00 | 574,324,600 | 1.14 |
| 日本 | 株式 | ファナック | 電気機器 | 56,400 | 10,458.05 | 589,834,216 | 10,140.00 | 571,896,000 | 1.14 |
| 日本 | 株式 | 富士フィルムホールディングス | 化学 | 208,800 | 3,152.74 | 658,292,112 | 2,588.00 | 540,374,400 | 1.07 |
| 日本 | 株式 | ヤフー | 情報・通信業 | 14,880 | 35,066.75 | 521,793,256 | 35,650.00 | 530,472,000 | 1.05 |
| 日本 | 株式 | ソニー | 電気機器 | 217,700 | 3,251.66 | 707,886,742 | 2,383.00 | 518,779,100 | 1.03 |
| 日本 | 株式 | 東海旅客鉄道 | 陸運業 | 674 | 733,788.64 | 494,573,546 | 734,000.00 | 494,716,000 | 0.98 |
| 日本 | 株式 | ジェイエフイーホールディングス | 鉄鋼 | 173,500 | 3,484.29 | 604,524,315 | 2,780.00 | 482,330,000 | 0.96 |
| 日本 | 株式 | 東日本旅客鉄道 | 陸運業 | 79,200 | 6,410.00 | 507,672,000 | 5,930.00 | 469,656,000 | 0.93 |
| 日本 | 株式 | 日本たばこ産業 | 食料品 | 1,666 | 318,344.69 | 530,362,253 | 277,700.00 | 462,648,200 | 0.92 |
| 日本 | 株式 | 伊藤忠商事 | 卸売業 | 643,000 | 869.00 | 558,767,000 | 705.00 | 453,315,000 | 0.90 |
| 日本 | 株式 | 三井不動産 | 不動産業 | 345,000 | 1,610.65 | 555,675,834 | 1,251.00 | 431,595,000 | 0.86 |
| 日本 | 株式 | 東芝 | 電気機器 | 941,000 | 508.23 | 478,244,430 | 445.00 | 418,745,000 | 0.83 |
| 日本 | 株式 | りそなホールディングス | 銀行業 | 376,000 | 1,147.78 | 431,568,181 | 1,091.00 | 410,216,000 | 0.82 |

| | | | | | | | | | |
|----|----|----------|-------|-----------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| 日本 | 株式 | 楽天 | サービス業 | 6,351 | 66,933.33 | 425,093,627 | 64,100.00 | 407,099,100 | 0.81 |
| 日本 | 株式 | 古河電気工業 | 非鉄金属 | 891,000 | 457.25 | 407,411,499 | 392.00 | 349,272,000 | 0.69 |
| 日本 | 株式 | エルピーダメモリ | 電気機器 | 246,000 | 2,006.95 | 493,709,700 | 1,391.00 | 342,186,000 | 0.68 |
| 日本 | 株式 | 全日本空輸 | 空運業 | 1,179,000 | 284.65 | 335,602,350 | 283.00 | 333,657,000 | 0.66 |

投資有価証券種類別及び業種別投資比率

(2010年6月30日現在)

| 国内 / 外国 | 種類 | 業種 | 投資比率 (%) |
|------------|------|----------|----------|
| 国内 | 株式 | 鉱業 | 0.01 |
| | | 建設業 | 2.32 |
| | | 食料品 | 2.15 |
| | | 繊維製品 | 0.03 |
| | | パルプ・紙 | 0.10 |
| | | 化学 | 6.91 |
| | | 医薬品 | 4.57 |
| | | 石油・石炭製品 | 0.82 |
| | | ゴム製品 | 0.43 |
| | | ガラス・土石製品 | 1.37 |
| | | 鉄鋼 | 2.42 |
| | | 非鉄金属 | 1.71 |
| | | 金属製品 | 1.09 |
| | | 機械 | 2.55 |
| | | 電気機器 | 13.43 |
| | | 輸送用機器 | 6.84 |
| | | 精密機器 | 2.06 |
| | | その他製品 | 2.14 |
| | | 電気・ガス業 | 4.89 |
| | | 陸運業 | 2.61 |
| | | 海運業 | 0.17 |
| | | 空運業 | 0.66 |
| | | 倉庫・運輸関連業 | 0.07 |
| 情報・通信業 | 8.83 | | |
| 卸売業 | 5.37 | | |
| 小売業 | 4.04 | | |
| 銀行業 | 6.99 | | |
| 証券、商品先物取引業 | 0.95 | | |
| 保険業 | 1.22 | | |
| その他金融業 | 1.70 | | |
| 不動産業 | 1.99 | | |
| サービス業 | 3.21 | | |
| | 投資証券 | | 0.04 |
| | 合計 | | 93.65 |

[前](#) [次](#)

ラッセル外国株式マザーファンド

(2010年6月30日現在)

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿価額 単価 (円) | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----------|----|---------------------------------|------------------------|---------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| スイス | 株式 | NESTLE SA-REG | 食品・飲料・タバコ | 145,700 | 4,334.20 | 631,493,483 | 4,277.51 | 623,234,445 | 1.68 |
| アメリカ | 株式 | INTEL CORP | 半導体・半導体製造装置 | 312,804 | 2,116.44 | 662,031,398 | 1,750.13 | 547,449,040 | 1.48 |
| スイス | 株式 | CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A | 耐久消費財・アパレル | 157,029 | 3,315.79 | 520,675,470 | 3,137.66 | 492,704,240 | 1.33 |
| イギリス | 株式 | GLAXOSMITHKLINE PLC | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 313,254 | 1,691.42 | 529,846,128 | 1,494.37 | 468,119,290 | 1.26 |
| スイス | 株式 | JULIUS BAER GROUP LTD | 各種金融 | 172,212 | 3,012.97 | 518,870,442 | 2,529.74 | 435,651,860 | 1.17 |
| アメリカ | 株式 | BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 各種金融 | 185,856 | 2,793.31 | 519,154,092 | 2,221.73 | 412,922,371 | 1.11 |
| イギリス | 株式 | DIAGEO PLC | 食品・飲料・タバコ | 281,756 | 1,523.30 | 429,199,317 | 1,407.88 | 396,678,806 | 1.07 |
| アメリカ | 株式 | JP MORGAN CHASE & CO | 各種金融 | 117,522 | 3,959.19 | 465,292,266 | 3,279.06 | 385,362,723 | 1.04 |
| アメリカ | 株式 | APPLE INC | テクノロジー・ハード ウェアおよび機器 | 16,199 | 22,027.08 | 356,816,739 | 22,657.95 | 367,036,268 | 0.99 |
| オランダ | 株式 | KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRON | 資本財 | 132,323 | 2,603.61 | 344,517,684 | 2,660.75 | 352,078,528 | 0.95 |
| アメリカ | 株式 | THE WALT DISNEY CO | メディア | 119,480 | 3,170.23 | 378,780,084 | 2,857.90 | 341,462,369 | 0.92 |
| フランス | 株式 | DANONE GROUP | 食品・飲料・タバコ | 65,429 | 4,860.94 | 318,046,587 | 4,770.59 | 312,135,096 | 0.84 |
| アメリカ | 株式 | WELLS FARGO & CO | 銀行 | 131,467 | 2,880.90 | 378,744,437 | 2,294.28 | 301,622,950 | 0.81 |
| フランス | 株式 | SANOFI-AVENTIS | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 57,242 | 5,781.58 | 330,949,263 | 5,248.72 | 300,447,794 | 0.81 |
| ドイツ | 株式 | LINDE AG | 素材 | 31,205 | 9,434.45 | 294,402,108 | 9,412.89 | 293,729,266 | 0.79 |
| オランダ | 株式 | HEINEKEN NV | 食品・飲料・タバコ | 77,358 | 3,954.47 | 305,909,952 | 3,785.20 | 292,816,205 | 0.79 |
| スイス | 株式 | CREDIT SUISSE GROUP-REG | 各種金融 | 82,964 | 4,374.93 | 362,961,930 | 3,341.93 | 277,260,627 | 0.75 |
| スペイン | 株式 | INDITEX | 小売 | 53,116 | 5,159.51 | 274,052,889 | 5,088.63 | 270,287,777 | 0.73 |
| 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 半導体・半導体製造装置 | 4,637 | 60,340.06 | 279,796,883 | 56,628.00 | 262,584,036 | 0.71 |
| アメリカ | 株式 | HEWLETT-PACKARD CO | テクノロジー・ハード ウェアおよび機器 | 66,050 | 4,755.80 | 314,120,590 | 3,919.66 | 258,893,807 | 0.70 |
| アメリカ | 株式 | CISCO SYSTEMS INC | テクノロジー・ハード ウェアおよび機器 | 134,085 | 2,386.30 | 319,967,786 | 1,912.93 | 256,496,238 | 0.69 |
| オランダ | 株式 | AKZO NOBEL | 素材 | 54,653 | 4,666.19 | 255,021,325 | 4,658.47 | 254,599,366 | 0.69 |
| スイス | 株式 | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 20,579 | 14,307.42 | 294,432,416 | 12,240.15 | 251,890,211 | 0.68 |
| スイス | 株式 | UBS AG-REG | 各種金融 | 210,731 | 1,465.06 | 308,733,622 | 1,180.70 | 248,812,093 | 0.67 |
| アメリカ | 株式 | STATE STREET CORP | 各種金融 | 81,865 | 4,060.80 | 332,437,789 | 3,003.89 | 245,913,946 | 0.66 |
| イギリス | 株式 | RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 家庭用品・パーソナル用 品 | 59,305 | 4,631.92 | 274,696,145 | 4,098.55 | 243,064,863 | 0.65 |
| スイス | 株式 | GIVAUDAN-REG | 素材 | 3,182 | 77,988.10 | 248,158,164 | 75,091.48 | 238,941,121 | 0.64 |
| アメリカ | 株式 | ORACLE CORP | ソフトウェア・サービス | 121,350 | 2,296.05 | 278,626,395 | 1,924.44 | 233,530,794 | 0.63 |
| アメリカ | 株式 | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 銀行 | 44,899 | 5,583.81 | 250,707,496 | 5,094.67 | 228,745,965 | 0.62 |
| アメリカ | 株式 | NATIONAL OILWELL VARCO INC | エネルギー | 76,960 | 3,733.44 | 287,326,157 | 2,921.60 | 224,847,074 | 0.61 |

投資有価証券種類別及び業種別投資比率

(2010年6月30日現在)

| 国内/外国 | 種類 | 業種 | 投資比率(%) |
|-------------|------|------------------------|---------|
| 外国 | 株式 | エネルギー | 3.89 |
| | | 素材 | 6.62 |
| | | 資本財 | 7.08 |
| | | 商業・専門サービス | 1.58 |
| | | 運輸 | 1.67 |
| | | 自動車・自動車部品 | 1.24 |
| | | 耐久消費財・アパレル | 4.12 |
| | | 消費者サービス | 2.29 |
| | | メディア | 4.08 |
| | | 小売 | 3.30 |
| | | 食品・生活必需品小売り | 1.56 |
| | | 食品・飲料・タバコ | 8.85 |
| | | 家庭用品・パーソナル用品 | 1.92 |
| | | ヘルスケア機器・サービス | 4.24 |
| | | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 7.46 |
| | | 銀行 | 5.91 |
| | | 各種金融 | 7.47 |
| | | 保険 | 3.07 |
| | | 不動産 | 0.81 |
| | | ソフトウェア・サービス | 4.22 |
| | | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 5.03 |
| 電気通信サービス | 1.94 | | |
| 公益事業 | 1.24 | | |
| 半導体・半導体製造装置 | 3.69 | | |
| | 合計 | | 93.27 |

[前へ](#) [次へ](#)

ラッセル日本債券マザーファンド

(2010年6月30日現在)

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額 単価 (円) | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 金額 (円) | 利率 (%) | 償還 期限 | 投資 比率 (%) |
|----------|------------|-----------------------------|---------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------|-------------|-----------------|
| 日本 | 国債証券 | 第306回 利付国債(10年) | 1,180,000,000 | 100.86 | 1,190,249,800 | 103.17 | 1,217,453,200 | 1.4 | 2020年3月20日 | 8.04 |
| 日本 | 国債証券 | 第88回 利付国債(5年) | 1,060,000,000 | 100.31 | 1,063,323,300 | 100.81 | 1,068,596,600 | 0.5 | 2015年3月20日 | 7.06 |
| 日本 | 国債証券 | 第288回 利付国債(10年) | 870,000,000 | 105.97 | 921,946,550 | 107.60 | 936,146,100 | 1.7 | 2017年9月20日 | 6.18 |
| 日本 | 国債証券 | 第305回 利付国債(10年) | 904,000,000 | 100.34 | 907,075,240 | 102.59 | 927,431,680 | 1.3 | 2019年12月20日 | 6.13 |
| 日本 | 国債証券 | 第114回 利付国債(20年) | 703,000,000 | 99.73 | 701,137,300 | 104.62 | 735,513,750 | 2.1 | 2029年12月20日 | 4.86 |
| 日本 | 国債証券 | 第270回 利付国債(10年) | 700,000,000 | 103.68 | 725,802,000 | 104.68 | 732,767,000 | 1.3 | 2015年6月20日 | 4.84 |
| 日本 | 社債券 | 第25回 ソフトバンク無担保社債 | 700,000,000 | 103.15 | 722,071,000 | 102.48 | 717,395,000 | 3.39 | 2011年6月17日 | 4.74 |
| 日本 | 国債証券 | 第308回 利付国債(10年) | 600,000,000 | 100.69 | 604,140,000 | 101.97 | 611,868,000 | 1.3 | 2020年6月20日 | 4.04 |
| 日本 | 国債証券 | 第296回 利付国債(10年) | 400,000,000 | 102.84 | 411,378,380 | 105.55 | 422,224,000 | 1.5 | 2018年9月20日 | 2.79 |
| 日本 | 社債券 | 第58回 住友不動産株式会社無担保社債 | 400,000,000 | 101.78 | 407,144,000 | 101.24 | 404,980,000 | 1.84 | 2011年7月29日 | 2.68 |
| 日本 | 国債証券 | 第95回 利付国債(20年) | 310,000,000 | 104.85 | 325,041,000 | 108.82 | 337,369,900 | 2.3 | 2027年6月20日 | 2.23 |
| 日本 | 社債券 | 第1回 株式会社アコーディア・ゴルフ無担保社債 | 300,000,000 | 101.83 | 305,514,000 | 101.40 | 304,206,000 | 2.1 | 2011年11月8日 | 2.01 |
| 日本 | 社債券 | 第1回 株式会社産業経済新聞社無担保社債 | 300,000,000 | 101.34 | 304,035,000 | 100.84 | 302,532,000 | 1.79 | 2011年9月28日 | 2.00 |
| 日本 | 国債証券 | 第280回 利付国債(10年) | 222,000,000 | 107.08 | 237,717,600 | 108.57 | 241,029,840 | 1.9 | 2016年6月20日 | 1.59 |
| 日本 | 新株予約権付社債券等 | 第1回 野村総合研究所無担保転換社債型新株予約権付社債 | 230,000,000 | 94.74 | 217,920,000 | 96.90 | 222,870,000 | 0 | 2014年3月31日 | 1.47 |
| 日本 | 国債証券 | 第85回 利付国債(5年) | 210,000,000 | 100.97 | 212,053,800 | 101.81 | 213,803,100 | 0.7 | 2014年9月20日 | 1.41 |
| 日本 | 国債証券 | 第284回 利付国債(2年) | 210,000,000 | 100.20 | 210,432,600 | 100.19 | 210,413,700 | 0.3 | 2011年9月15日 | 1.39 |
| 日本 | 社債券 | 第36回 株式会社クレディセゾン無担保社債 | 200,000,000 | 100.00 | 200,000,000 | 100.87 | 201,744,000 | 1.28 | 2013年4月22日 | 1.33 |
| フランス | 社債券 | 第7回 ルノー円貨社債 | 200,000,000 | 96.13 | 192,266,000 | 100.25 | 200,500,000 | 1.7 | 2011年1月24日 | 1.32 |
| 日本 | 社債券 | 第2回 森ビル株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 100.00 | 200,000,000 | 100.21 | 200,428,000 | 1.39 | 2013年4月26日 | 1.32 |
| 日本 | 社債券 | 第6回 株式会社ジャックス無担保社債 | 200,000,000 | 100.00 | 200,000,000 | 100.05 | 200,110,000 | 1.31 | 2013年6月28日 | 1.32 |
| 日本 | 新株予約権付社債券等 | HANKYU DEPT STORE ユーロ円CB | 200,000,000 | 98.33 | 196,670,000 | 98.18 | 196,368,000 | 0 | 2011年8月16日 | 1.30 |
| 日本 | 新株予約権付社債券等 | 第20回 シャープ無担保転換社債 | 200,000,000 | 95.89 | 191,785,809 | 97.90 | 195,800,000 | 0 | 2013年9月30日 | 1.29 |
| 日本 | 国債証券 | 第12回 利付国債(物価連動10年) | 195,000,000 | 96.05 | 188,141,721 | 97.50 | 189,554,625 | 1.2 | 2017年6月10日 | 1.25 |
| 日本 | 国債証券 | 第20回 利付国債(30年) | 160,000,000 | 106.07 | 169,720,000 | 111.65 | 178,646,400 | 2.5 | 2035年9月20日 | 1.18 |
| 日本 | 新株予約権付社債券等 | KAWASAKI KISEN ユーロ円CB | 175,000,000 | 94.38 | 165,175,000 | 97.21 | 170,117,500 | 0 | 2013年4月4日 | 1.12 |
| 日本 | 国債証券 | 第110回 利付国債(20年) | 160,000,000 | 100.97 | 161,553,600 | 104.93 | 167,891,200 | 2.1 | 2029年3月20日 | 1.11 |
| 日本 | 国債証券 | 第84回 利付国債(20年) | 157,000,000 | 101.46 | 159,303,190 | 105.41 | 165,501,550 | 2 | 2025年12月20日 | 1.09 |

| | | | | | | | | | | |
|----|------------------------|-------------------------|-------------|--------|-------------|--------|-------------|-----|------------|------|
| 日本 | 新株予約 権 付社債券 等 | TORAY IND INC ユーロ円CB | 150,000,000 | 97.61 | 146,422,000 | 97.32 | 145,987,500 | 0 | 2012年3月12日 | 0.96 |
| 日本 | 国債証券 | 第14回 利付国債(30年) | 130,000,000 | 104.32 | 135,617,500 | 109.42 | 142,251,200 | 2.4 | 2034年3月20日 | 0.94 |

投資有価証券種類別投資比率

(2010年6月30日現在)

| 国内 / 外国 | 種類 | 投資比率 (%) |
|---------|------------|----------|
| 国内 | 新株予約権付社債券等 | 8.87 |
| | 国債証券 | 61.98 |
| | 特殊債券 | 0.67 |
| | 社債券 | 24.20 |
| 外国 | 社債券 | 1.99 |
| | 合計 | 97.71 |

[前](#) [次](#)

ラッセル外国債券マザーファンド

(2010年6月30日現在)

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額 単価 (円) | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 金額 (円) | 利率 (%) | 償還 期限 | 投資 比率 (%) |
|----------|------|--------------------------|---------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------|-------------|-----------------|
| ドイツ | 国債証券 | BUNDESBLIGATION | 7,000,000 | 10,905.30 | 763,371,345 | 10,843.74 | 759,062,179 | 2.5 | 2010年10月8日 | 5.42 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 7,000,000 | 8,830.30 | 618,121,280 | 9,123.79 | 638,665,451 | 2.375 | 2015年2月28日 | 4.56 |
| ドイツ | 国債証券 | BUNDESREPUB | 4,450,000 | 13,142.68 | 584,849,520 | 14,312.96 | 636,926,871 | 5.5 | 2031年1月4日 | 4.55 |
| ドイツ | 国債証券 | BUNDESREPUB | 3,000,000 | 13,245.53 | 397,366,098 | 14,253.88 | 427,616,505 | 5.625 | 2028年1月4日 | 3.05 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 3,860,000 | 10,000.98 | 386,037,939 | 10,898.17 | 420,669,365 | 5.5 | 2028年8月15日 | 3.00 |
| ドイツ | 特殊債券 | RENTEN BANK | 2,500,000 | 14,217.86 | 355,446,603 | 14,125.91 | 353,147,819 | 5.25 | 2012年1月18日 | 2.52 |
| ニュージーランド | 国債証券 | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 5,360,000 | 6,265.31 | 335,820,777 | 6,418.61 | 344,037,822 | 6 | 2017年12月15日 | 2.46 |
| ドイツ | 国債証券 | BUNDESREPUB | 2,400,000 | 11,768.53 | 282,444,950 | 12,306.08 | 295,345,926 | 4.25 | 2018年7月4日 | 2.11 |
| アメリカ | 特殊債券 | FREDDIE MAC DISCOUNT NT | 2,800,000 | 8,841.86 | 247,572,215 | 8,841.86 | 247,572,215 | - | 2010年10月12日 | 1.77 |
| メキシコ | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 26,750,000 | 830.85 | 222,253,374 | 873.23 | 233,591,325 | 10 | 2036年11月20日 | 1.67 |
| ブラジル | 国債証券 | BRAZIL NTN-F | 4,950,000 | 4,457.91 | 220,666,991 | 4,671.29 | 231,229,275 | 10 | 2017年1月1日 | 1.65 |
| ポーランド | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT | 8,090,000 | 2,590.33 | 209,557,881 | 2,528.68 | 204,570,674 | 5.25 | 2017年10月25日 | 1.46 |
| フランス | 社債券 | DEXIA CREDIT LOCAL | 2,200,000 | 8,848.00 | 194,656,000 | 8,836.58 | 194,404,893 | 0.80781 | 2014年4月29日 | 1.39 |
| イギリス | 社債券 | ROYAL BANK OF SCOTLAND | 1,400,000 | 13,893.97 | 194,515,604 | 13,818.65 | 193,461,158 | 4.125 | 2011年11月14日 | 1.38 |
| オーストラリア | 社債券 | MACQUARIE BK LTD | 2,000,000 | 9,337.73 | 186,754,736 | 9,532.74 | 190,654,934 | 4.1 | 2013年12月17日 | 1.36 |
| カナダ | 社債券 | BANK OF MONTREAL | 2,100,000 | 8,848.00 | 185,808,000 | 8,995.76 | 188,910,993 | 2.85 | 2015年6月9日 | 1.35 |
| オランダ | 社債券 | FORTIS BANK NED HOLDING | 1,700,000 | 11,105.07 | 188,786,306 | 11,067.77 | 188,152,168 | 3 | 2012年4月17日 | 1.34 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1,800,000 | 8,800.18 | 158,403,393 | 9,680.24 | 174,244,371 | 4.5 | 2039年8月15日 | 1.24 |
| メキシコ | 国債証券 | MEXICAN FIXED RATE BONDS | 24,690,000 | 646.35 | 159,584,037 | 693.61 | 171,253,864 | 7.5 | 2027年6月3日 | 1.22 |
| 韓国 | 国債証券 | KOREA TREASURY BOND | 2,140,000,000 | 7.30 | 156,394,195 | 7.25 | 155,182,742 | 5.75 | 2010年12月10日 | 1.11 |
| ドイツ | 国債証券 | BUNDESREPUB | 1,000,000 | 14,228.76 | 142,287,638 | 15,446.47 | 154,464,777 | 6.25 | 2030年1月4日 | 1.10 |
| イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,350,000 | 11,540.28 | 155,793,859 | 11,287.38 | 152,379,678 | 4.5 | 2018年2月1日 | 1.09 |
| ポーランド | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT | 5,390,000 | 2,621.85 | 141,318,248 | 2,592.06 | 139,712,135 | 5 | 2013年10月24日 | 1.00 |
| オーストラリア | 社債券 | NATL AUSTRALIA BANK | 1,790,000 | 7,568.56 | 135,477,347 | 7,606.42 | 136,155,094 | 5.75 | 2013年12月19日 | 0.97 |
| ドイツ | 国債証券 | BUNDESREPUB | 890,000 | 13,911.89 | 123,815,828 | 14,790.77 | 131,637,918 | 6.25 | 2024年1月4日 | 0.94 |
| ドイツ | 国債証券 | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN | 1,200,000 | 10,894.84 | 130,738,168 | 10,872.96 | 130,475,543 | 2.25 | 2010年12月10日 | 0.93 |
| オランダ | 社債券 | ING BANK NV | 1,300,000 | 9,170.06 | 119,210,873 | 9,489.56 | 123,364,390 | 3.9 | 2014年3月19日 | 0.88 |
| ニュージーランド | 国債証券 | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 1,890,000 | 6,350.79 | 120,030,027 | 6,441.58 | 121,746,045 | 6 | 2015年4月15日 | 0.87 |
| オランダ | 社債券 | LEASEPLAN CORPORATION NV | 1,100,000 | 10,907.13 | 119,978,514 | 10,877.38 | 119,651,203 | 3.375 | 2010年12月10日 | 0.85 |
| カナダ | 国債証券 | CANADIAN GOVERNMENT | 1,300,000 | 8,874.20 | 115,364,658 | 9,165.10 | 119,146,338 | 4.25 | 2018年6月1日 | 0.85 |

投資有価証券種類別投資比率

(2010年6月30日現在)

| 国内 / 外国 | 種類 | 投資比率 (%) |
|---------|-------|----------|
| 外国 | 国債証券 | 51.26 |
| | 地方債証券 | 1.52 |
| | 特殊債証券 | 10.61 |
| | 社債証券 | 29.04 |
| | 合計 | 92.43 |

[前](#) [次](#)

投資不動産物件
 ラッセル日本株式マザーファンド
 該当事項はありません。

ラッセル外国株式マザーファンド
 該当事項はありません。

ラッセル日本債券マザーファンド
 該当事項はありません。

ラッセル外国債券マザーファンド
 該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
 ラッセル日本株式マザーファンド

(2010年6月30日現在)

| 取引所 | 資産の名称 | 限月 | 売買区分 | 数量 | 帳簿価額(円) | 評価金額(円) | 投資比率(%) |
|---------|----------------|---------|------|-----|---------------|---------------|---------|
| 東京証券取引所 | TOPIX 株価指数先物取引 | 2010年9月 | 買建 | 373 | 3,183,539,515 | 3,127,605,000 | 6.22 |

(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比率をいいます。

ラッセル外国株式マザーファンド

(2010年6月30日現在)

| 取引所 | 資産の名称 | 限月 | 売買区分 | 数量 | 帳簿価額(円) | 評価金額(円) | 投資比率(%) |
|--------------------|------------------------|---------|------|-----|---------------|---------------|---------|
| シカゴ商業取引所 | S&P 500 EMINI 株価指数先物取引 | 2010年9月 | 買建 | 245 | 1,163,810,678 | 1,122,140,964 | 3.02 |
| ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | DJ EURO STOXX 株価指数先物取引 | 2010年9月 | 買建 | 150 | 437,914,797 | 413,828,685 | 1.12 |
| ロンドン国際金融先物オプション取引所 | FTSE 100 株価指数先物取引 | 2010年9月 | 買建 | 40 | 276,862,781 | 260,684,130 | 0.70 |
| シカゴ商業取引所 | S&P 500 株価指数先物取引 | 2010年9月 | 買建 | 9 | 212,063,201 | 206,107,524 | 0.56 |
| モントリオール取引所 | S&P/TSE 60 株価指数先物取引 | 2010年9月 | 買建 | 13 | 147,944,427 | 142,730,390 | 0.38 |
| シドニー先物取引所 | SPI 200 株価指数先物取引 | 2010年9月 | 買建 | 13 | 110,699,491 | 105,851,538 | 0.29 |
| ユーレックス・チューリッヒ取引所 | SWISS MKT 株価指数先物取引 | 2010年9月 | 買建 | 20 | 105,592,199 | 100,127,434 | 0.27 |
| 香港先物取引所 | HANG SENG 株価指数先物取引 | 2010年7月 | 買建 | 4 | 46,993,802 | 45,905,238 | 0.12 |

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

ラッセル日本債券マザーファンド

(2010年6月30日現在)

| 取引所 | 資産の名称 | 限月 | 売買区分 | 数量 | 帳簿価額(円) | 評価金額(円) | 投資比率(%) |
|-------------------|----------------|---------|------|---------|-------------|-------------|---------|
| シンガポール 国際金融取引所 | 10年ミニ国債標準物先物取引 | 2010年9月 | 買建 | 900,000 | 126,122,485 | 127,413,000 | 0.84 |

(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比率をいいます。

ラッセル外国債券マザーファンド

(2010年6月30日現在)

| 取引所 | 資産の名称 | 限月 | 売買区分 | 数量 | 帳簿価額(円) | 評価金額(円) | 投資比率(%) |
|------------------------|----------------------|---------|------|-----|---------------|---------------|---------|
| シカゴ商品取引所 | US 10YR NOTE 債券先物取引 | 2010年9月 | 買建 | 103 | 1,095,570,439 | 1,116,681,195 | 7.97 |
| シドニー先物取引所 | AUST 3YR BOND 債券先物取引 | 2010年9月 | 買建 | 55 | 426,342,009 | 428,500,322 | 3.06 |
| ユーレックス・ドイツ金融 先物取引所 | EURO-BUND 債券先物取引 | 2010年9月 | 買建 | 29 | 402,535,588 | 404,661,600 | 2.89 |
| シカゴ商品取引所 | US 5YR NOTE 債券先物取引 | 2010年9月 | 買建 | 30 | 311,145,450 | 314,359,769 | 2.24 |
| ロンドン国際金融先物オブ ション取引所 | LONG GILT 債券先物取引 | 2010年9月 | 買建 | 16 | 253,812,395 | 256,942,201 | 1.83 |
| モントリオール取引所 | CAN 10YR BOND 債券先物取引 | 2010年9月 | 買建 | 6 | 61,377,653 | 62,131,492 | 0.44 |
| ロンドン国際金融先物オブ ション取引所 | 3M EURIBOR 金利先物取引 | 2011年9月 | 買建 | 164 | 4,336,005,000 | 4,367,388,490 | 31.19 |
| シカゴ商品取引所 | US 10YR 債券オプション取引 | 2010年8月 | 売建 | 8 | 219,430 | 77,423 | 0.00 |

(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比率をいいます。

[前へ](#)

第2【財務ハイライト情報】

<更新後>

- 以下の情報は、有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報 第4 ファンドの経理状況」の財務諸表および中間財務諸表から抜粋して記載しております。
- 財務諸表および中間財務諸表は、あらた監査法人により監査および中間監査を受けております。なお、当該監査証明に係る監査報告書および中間監査報告書は、有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報 第4 ファンドの経理状況」に添付されております。
(略)

<追加>

【三菱UFJ MV20】

1【中間貸借対照表】

(単位：円)

| | 第9期中間計算期間末 [平成21年6月12日現在] | 第10期中間計算期間末 [平成22年6月14日現在] |
|-----------------|------------------------------|-------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 75,474,582 | 66,803,992 |
| 投資信託受益証券 | 5,862,581,681 | 5,242,582,891 |
| 未収利息 | 238 | 188 |
| 流動資産合計 | 5,938,056,501 | 5,309,387,071 |
| 資産合計 | 5,938,056,501 | 5,309,387,071 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 6,767,331 | 4,828,120 |
| 未払受託者報酬 | 608,665 | 577,447 |
| 未払委託者報酬 | 20,694,605 | 19,633,016 |
| 流動負債合計 | 28,070,601 | 25,038,583 |
| 負債合計 | 28,070,601 | 25,038,583 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ¹ 6,103,813,034 | ¹ 5,178,711,356 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | ² 193,827,134 | ² 105,637,132 |
| (分配準備積立金) | 265,776,590 | 220,210,128 |
| 元本等合計 | 5,909,985,900 | 5,284,348,488 |
| 純資産合計 | 5,909,985,900 | 5,284,348,488 |
| 負債純資産合計 | 5,938,056,501 | 5,309,387,071 |

2【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

| | 第9期中間計算期間 自平成20年12月13日 至平成21年6月12日 | 第10期中間計算期間 自平成21年12月15日 至平成22年6月14日 |
|-------------------------|--|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 36,531 | 29,543 |
| 有価証券売買等損益 | 310,311,458 | 131,582,108 |
| 営業収益合計 | 310,347,989 | 131,611,651 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 608,665 | 577,447 |
| 委託者報酬 | 20,694,605 | 19,633,016 |
| 営業費用合計 | 21,303,270 | 20,210,463 |
| 営業利益 | 289,044,719 | 111,401,188 |
| 経常利益 | 289,044,719 | 111,401,188 |
| 中間純利益 | 289,044,719 | 111,401,188 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額 | 3,833,318 | 9,618,099 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 495,819,749 | 2,446,680 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 21,833,935 | 1,407,363 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 21,833,935 | 90,418 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | 1,316,945 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 5,052,721 | - |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 5,052,721 | - |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 193,827,134 | 105,637,132 |

3【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 第9期中間計算期間 (自平成20年12月13日 至平成21年6月12日) | 第10期中間計算期間 (自平成21年12月15日 至平成22年6月14日) |
|---------------------------|--|--|
| 1 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(1) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券以外の有価証券 個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における中間計算期間末日の最終相場で評価しております。</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> | <p>(1) 投資信託受益証券 同 左</p> <p>(2) 投資信託受益証券以外の有価証券 同 左</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券 同 左</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同 左</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 同 左</p> |
| 2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | | <p>ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月12日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当中間計算期間は平成21年12月15日から平成22年6月14日までとなっております。</p> |

(中間貸借対照表に関する注記)

| | 第9期中間計算期間末 [平成21年6月12日現在] | 第10期中間計算期間末 [平成22年6月14日現在] |
|---|------------------------------|-------------------------------|
| 1 期首元本額 | 6,307,566,152円 | 5,666,874,768円 |
| 期中追加設定元本額 | 71,780,863円 | 75,011,305円 |
| 期中一部解約元本額 | 275,533,981円 | 563,174,717円 |
| 2 元本の欠損 中間貸借対照表上の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。 | 193,827,134円 | |
| 3 中間計算期間末日における受益権の総数 | 6,103,813,034口 | 5,178,711,356口 |
| 4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.9682円 (9,682円) | 1.0204円 (10,204円) |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(有価証券関係に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

【三菱UFJ MV40】

1【中間貸借対照表】

(単位：円)

| | 第 9 期中間計算期間末 [平成21年6月12日現在] | 第 10 期中間計算期間末 [平成22年6月14日現在] |
|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 74,649,599 | 80,595,381 |
| 投資信託受益証券 | 5,985,104,660 | 5,364,028,507 |
| 未収入金 | 15,000,000 | 21,000,000 |
| 未収利息 | 235 | 226 |
| 流動資産合計 | 6,074,754,494 | 5,465,624,114 |
| 資産合計 | | |
| | 6,074,754,494 | 5,465,624,114 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 9,750,300 | 37,374,155 |
| 未払受託者報酬 | 593,731 | 603,399 |
| 未払委託者報酬 | 22,264,858 | 22,627,387 |
| 流動負債合計 | 32,608,889 | 60,604,941 |
| 負債合計 | | |
| | 32,608,889 | 60,604,941 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ¹ 6,415,760,099 | ¹ 5,567,466,325 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | ² 373,614,494 | ² 162,447,152 |
| （分配準備積立金） | 547,156,398 | 457,482,556 |
| 元本等合計 | 6,042,145,605 | 5,405,019,173 |
| 純資産合計 | | |
| | 6,042,145,605 | 5,405,019,173 |
| 負債純資産合計 | | |
| | 6,074,754,494 | 5,465,624,114 |

2【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第 9 期中間計算期間 自 平成20年12月13日 至 平成21年 6月12日 | 第 10 期中間計算期間 自 平成21年12月15日 至 平成22年 6月14日 |
|-------------------------|---|--|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 37,409 | 31,127 |
| 有価証券売買等損益 | 520,887,775 | 90,125,254 |
| 営業収益合計 | 520,925,184 | 90,156,381 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 593,731 | 603,399 |
| 委託者報酬 | 22,264,858 | 22,627,387 |
| 営業費用合計 | 22,858,589 | 23,230,786 |
| 営業利益 | 498,066,595 | 66,925,595 |
| 経常利益 | 498,066,595 | 66,925,595 |
| 中間純利益 | 498,066,595 | 66,925,595 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額 | 2,729,127 | 14,660,059 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 886,898,136 | 239,367,578 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 35,204,926 | 26,602,940 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 35,204,926 | 26,602,940 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 17,258,752 | 1,948,050 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 17,258,752 | 1,948,050 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 373,614,494 | 162,447,152 |

3【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 第9期中間計算期間 (自平成20年12月13日 至平成21年6月12日) | 第10期中間計算期間 (自平成21年12月15日 至平成22年6月14日) |
|---------------------------|--|--|
| 1 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(1) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券以外の有価証券 個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における中間計算期間末日の最終相場で評価しております。</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> | <p>(1) 投資信託受益証券 同 左</p> <p>(2) 投資信託受益証券以外の有価証券 同 左</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券 同 左</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同 左</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 同 左</p> |
| 2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | | <p>ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月12日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当中間計算期間は平成21年12月15日から平成22年6月14日までとなっております。</p> |

(中間貸借対照表に関する注記)

| | 第9期中間計算期間末 [平成21年6月12日現在] | 第10期中間計算期間末 [平成22年6月14日現在] |
|---|------------------------------|-------------------------------|
| 1 期首元本額 | 6,544,555,135円 | 6,126,006,071円 |
| 期中追加設定元本額 | 129,570,798円 | 113,696,702円 |
| 期中一部解約元本額 | 258,365,834円 | 672,236,448円 |
| 2 元本の欠損 中間貸借対照表上の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。 | 373,614,494円 | 162,447,152円 |
| 3 中間計算期間末日における受益権の総数 | 6,415,760,099口 | 5,567,466,325口 |
| 4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.9418円 (9,418円) | 0.9708円 (9,708円) |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(有価証券関係に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

【三菱UFJ MV80】

1【中間貸借対照表】

(単位：円)

| | 第 9 期中間計算期間末 [平成21年6月12日現在] | 第 10 期中間計算期間末 [平成22年6月14日現在] |
|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 50,971,339 | 61,344,783 |
| 投資信託受益証券 | 3,645,888,907 | 3,511,851,172 |
| 未収利息 | 161 | 172 |
| 流動資産合計 | 3,696,860,407 | 3,573,196,127 |
| 資産合計 | 3,696,860,407 | 3,573,196,127 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 230,884 | 2,508,709 |
| 未払受託者報酬 | 330,475 | 390,354 |
| 未払委託者報酬 | 14,871,105 | 17,566,052 |
| 流動負債合計 | 15,432,464 | 20,465,115 |
| 負債合計 | 15,432,464 | 20,465,115 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 4,268,595,841 | 1 4,170,064,734 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 2 587,167,898 | 2 617,333,722 |
| （分配準備積立金） | 679,421,007 | 609,332,562 |
| 元本等合計 | 3,681,427,943 | 3,552,731,012 |
| 純資産合計 | 3,681,427,943 | 3,552,731,012 |
| 負債純資産合計 | 3,696,860,407 | 3,573,196,127 |

2【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

| | 第9期中間計算期間 自平成20年12月13日 至平成21年6月12日 | 第10期中間計算期間 自平成21年12月15日 至平成22年6月14日 |
|-------------------------|--|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 22,715 | 23,588 |
| 有価証券売買等損益 | 549,067,038 | 27,942,636 |
| 営業収益合計 | 549,089,753 | 27,919,048 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 330,475 | 390,354 |
| 委託者報酬 | 14,871,105 | 17,566,052 |
| 営業費用合計 | 15,201,580 | 17,956,406 |
| 営業利益 | 533,888,173 | 45,875,454 |
| 経常利益 | 533,888,173 | 45,875,454 |
| 中間純利益 | 533,888,173 | 45,875,454 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額 | 73,830 | 5,888,003 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 1,113,855,318 | 572,946,327 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 47,390,878 | 26,811,940 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 47,390,878 | 26,811,940 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 54,665,461 | 19,435,878 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 54,665,461 | 19,435,878 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 587,167,898 | 617,333,722 |

3【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 第9期中間計算期間 (自平成20年12月13日 至平成21年6月12日) | 第10期中間計算期間 (自平成21年12月15日 至平成22年6月14日) |
|---------------------------|--|--|
| 1 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(1) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券以外の有価証券 個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における中間計算期間末日の最終相場で評価しております。</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> | <p>(1) 投資信託受益証券 同 左</p> <p>(2) 投資信託受益証券以外の有価証券 同 左</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券 同 左</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同 左</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 同 左</p> |
| 2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | | <p>ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月12日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当中間計算期間は平成21年12月15日から平成22年6月14日までとなっております。</p> |

(中間貸借対照表に関する注記)

| | 第9期中間計算期間末 [平成21年6月12日現在] | 第10期中間計算期間末 [平成22年6月14日現在] |
|---|------------------------------|-------------------------------|
| 1 期首元本額 | 4,242,922,267円 | 4,192,057,328円 |
| 期中追加設定元本額 | 205,239,053円 | 173,799,902円 |
| 期中一部解約元本額 | 179,565,479円 | 195,792,496円 |
| 2 元本の欠損 中間貸借対照表上の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。 | 587,167,898円 | 617,333,722円 |
| 3 中間計算期間末日における受益権の総数 | 4,268,595,841口 | 4,170,064,734口 |
| 4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.8624円 (8,624円) | 0.8520円 (8,520円) |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(有価証券関係に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

第三部【ファンドの詳細情報】

第4【ファンドの経理状況】

<追加>

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、第9期中間計算期間（平成20年12月13日から平成21年6月12日まで）については、改正前の「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、第10期中間計算期間（平成21年12月15日から平成22年6月14日まで）については、改正後の「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。ただし、第10期中間計算期間については「投資信託及び投資法人に関する法律施行規則等の一部を改正する内閣府令」（平成21年内閣府令第35号）の附則第16条第2項本文を適用しております。

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、第9期中間計算期間（平成20年12月13日から平成21年6月12日まで）および第10期中間計算期間（平成21年12月15日から平成22年6月14日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人により中間監査を受けております。

【三菱UFJ MV20】
 (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

| | 第 9 期中間計算期間末 [平成21年6月12日現在] | 第 10 期中間計算期間末 [平成22年6月14日現在] |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 75,474,582 | 66,803,992 |
| 投資信託受益証券 | 5,862,581,681 | 5,242,582,891 |
| 未収利息 | 238 | 188 |
| 流動資産合計 | 5,938,056,501 | 5,309,387,071 |
| 資産合計 | 5,938,056,501 | 5,309,387,071 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 6,767,331 | 4,828,120 |
| 未払受託者報酬 | 608,665 | 577,447 |
| 未払委託者報酬 | 20,694,605 | 19,633,016 |
| 流動負債合計 | 28,070,601 | 25,038,583 |
| 負債合計 | 28,070,601 | 25,038,583 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ¹ 6,103,813,034 | ¹ 5,178,711,356 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | ² 193,827,134 | ² 105,637,132 |
| （分配準備積立金） | 265,776,590 | 220,210,128 |
| 元本等合計 | 5,909,985,900 | 5,284,348,488 |
| 純資産合計 | 5,909,985,900 | 5,284,348,488 |
| 負債純資産合計 | 5,938,056,501 | 5,309,387,071 |

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

| | 第9期中間計算期間 自平成20年12月13日 至平成21年6月12日 | 第10期中間計算期間 自平成21年12月15日 至平成22年6月14日 |
|-------------------------|--|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 36,531 | 29,543 |
| 有価証券売買等損益 | 310,311,458 | 131,582,108 |
| 営業収益合計 | 310,347,989 | 131,611,651 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 608,665 | 577,447 |
| 委託者報酬 | 20,694,605 | 19,633,016 |
| 営業費用合計 | 21,303,270 | 20,210,463 |
| 営業利益 | 289,044,719 | 111,401,188 |
| 経常利益 | 289,044,719 | 111,401,188 |
| 中間純利益 | 289,044,719 | 111,401,188 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額 | 3,833,318 | 9,618,099 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 495,819,749 | 2,446,680 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 21,833,935 | 1,407,363 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 21,833,935 | 90,418 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | 1,316,945 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 5,052,721 | - |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 5,052,721 | - |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 193,827,134 | 105,637,132 |

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 第9期中間計算期間 (自平成20年12月13日 至平成21年6月12日) | 第10期中間計算期間 (自平成21年12月15日 至平成22年6月14日) |
|---------------------------|--|---|
| 1 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(1) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券以外の有価証券 個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における中間計算期間末日の最終相場で評価しております。</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> | <p>(1) 投資信託受益証券 同左</p> <p>(2) 投資信託受益証券以外の有価証券 同左</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 同左</p> |
| 2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | | <p>ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月12日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当中間計算期間は平成21年12月15日から平成22年6月14日までとなっております。</p> |

(中間貸借対照表に関する注記)

| | 第9期中間計算期間末 [平成21年6月12日現在] | 第10期中間計算期間末 [平成22年6月14日現在] |
|---|------------------------------|-------------------------------|
| 1 期首元本額 | 6,307,566,152円 | 5,666,874,768円 |
| 期中追加設定元本額 | 71,780,863円 | 75,011,305円 |
| 期中一部解約元本額 | 275,533,981円 | 563,174,717円 |
| 2 元本の欠損 中間貸借対照表上の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。 | 193,827,134円 | |
| 3 中間計算期間末日における受益権の総数 | 6,103,813,034口 | 5,178,711,356口 |
| 4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.9682円 (9,682円) | 1.0204円 (10,204円) |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(有価証券関係に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

【三菱UFJ MV40】
 (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

| | 第 9 期中間計算期間末 [平成21年6月12日現在] | 第 10 期中間計算期間末 [平成22年6月14日現在] |
|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 74,649,599 | 80,595,381 |
| 投資信託受益証券 | 5,985,104,660 | 5,364,028,507 |
| 未収入金 | 15,000,000 | 21,000,000 |
| 未収利息 | 235 | 226 |
| 流動資産合計 | 6,074,754,494 | 5,465,624,114 |
| 資産合計 | 6,074,754,494 | 5,465,624,114 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 9,750,300 | 37,374,155 |
| 未払受託者報酬 | 593,731 | 603,399 |
| 未払委託者報酬 | 22,264,858 | 22,627,387 |
| 流動負債合計 | 32,608,889 | 60,604,941 |
| 負債合計 | 32,608,889 | 60,604,941 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ¹ 6,415,760,099 | ¹ 5,567,466,325 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | ² 373,614,494 | ² 162,447,152 |
| （分配準備積立金） | 547,156,398 | 457,482,556 |
| 元本等合計 | 6,042,145,605 | 5,405,019,173 |
| 純資産合計 | 6,042,145,605 | 5,405,019,173 |
| 負債純資産合計 | 6,074,754,494 | 5,465,624,114 |

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第9期中間計算期間 自平成20年12月13日 至平成21年6月12日 | 第10期中間計算期間 自平成21年12月15日 至平成22年6月14日 |
|-------------------------|--|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 37,409 | 31,127 |
| 有価証券売買等損益 | 520,887,775 | 90,125,254 |
| 営業収益合計 | 520,925,184 | 90,156,381 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 593,731 | 603,399 |
| 委託者報酬 | 22,264,858 | 22,627,387 |
| 営業費用合計 | 22,858,589 | 23,230,786 |
| 営業利益 | 498,066,595 | 66,925,595 |
| 経常利益 | 498,066,595 | 66,925,595 |
| 中間純利益 | 498,066,595 | 66,925,595 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額 | 2,729,127 | 14,660,059 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 886,898,136 | 239,367,578 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 35,204,926 | 26,602,940 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 35,204,926 | 26,602,940 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 17,258,752 | 1,948,050 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 17,258,752 | 1,948,050 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 373,614,494 | 162,447,152 |

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 第9期中間計算期間 (自平成20年12月13日 至平成21年6月12日) | 第10期中間計算期間 (自平成21年12月15日 至平成22年6月14日) |
|---------------------------|--|--|
| 1 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(1) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券以外の有価証券 個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における中間計算期間末日の最終相場で評価しております。</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> | <p>(1) 投資信託受益証券 同 左</p> <p>(2) 投資信託受益証券以外の有価証券 同 左</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券 同 左</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同 左</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 同 左</p> |
| 2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | | <p>ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月12日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当中間計算期間は平成21年12月15日から平成22年6月14日までとなっております。</p> |

(中間貸借対照表に関する注記)

| | 第9期中間計算期間末 [平成21年6月12日現在] | 第10期中間計算期間末 [平成22年6月14日現在] |
|---|------------------------------|-------------------------------|
| 1 期首元本額 | 6,544,555,135円 | 6,126,006,071円 |
| 期中追加設定元本額 | 129,570,798円 | 113,696,702円 |
| 期中一部解約元本額 | 258,365,834円 | 672,236,448円 |
| 2 元本の欠損 中間貸借対照表上の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。 | 373,614,494円 | 162,447,152円 |
| 3 中間計算期間末日における受益権の総数 | 6,415,760,099口 | 5,567,466,325口 |
| 4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.9418円 (9,418円) | 0.9708円 (9,708円) |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(有価証券関係に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

【三菱UFJ MV80】
 (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

| | 第 9 期中間計算期間末 [平成21年6月12日現在] | 第 10 期中間計算期間末 [平成22年6月14日現在] |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 50,971,339 | 61,344,783 |
| 投資信託受益証券 | 3,645,888,907 | 3,511,851,172 |
| 未収利息 | 161 | 172 |
| 流動資産合計 | 3,696,860,407 | 3,573,196,127 |
| 資産合計 | 3,696,860,407 | 3,573,196,127 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 230,884 | 2,508,709 |
| 未払受託者報酬 | 330,475 | 390,354 |
| 未払委託者報酬 | 14,871,105 | 17,566,052 |
| 流動負債合計 | 15,432,464 | 20,465,115 |
| 負債合計 | 15,432,464 | 20,465,115 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 4,268,595,841 | 1 4,170,064,734 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 2 587,167,898 | 2 617,333,722 |
| (分配準備積立金) | 679,421,007 | 609,332,562 |
| 元本等合計 | 3,681,427,943 | 3,552,731,012 |
| 純資産合計 | 3,681,427,943 | 3,552,731,012 |
| 負債純資産合計 | 3,696,860,407 | 3,573,196,127 |

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第 9 期中間計算期間 自 平成20年12月13日 至 平成21年 6月12日 | 第 10 期中間計算期間 自 平成21年12月15日 至 平成22年 6月14日 |
|-------------------------|---|--|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 22,715 | 23,588 |
| 有価証券売買等損益 | 549,067,038 | 27,942,636 |
| 営業収益合計 | 549,089,753 | 27,919,048 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 330,475 | 390,354 |
| 委託者報酬 | 14,871,105 | 17,566,052 |
| 営業費用合計 | 15,201,580 | 17,956,406 |
| 営業利益 | 533,888,173 | 45,875,454 |
| 経常利益 | 533,888,173 | 45,875,454 |
| 中間純利益 | 533,888,173 | 45,875,454 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額 | 73,830 | 5,888,003 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 1,113,855,318 | 572,946,327 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 47,390,878 | 26,811,940 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 47,390,878 | 26,811,940 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 54,665,461 | 19,435,878 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 54,665,461 | 19,435,878 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 587,167,898 | 617,333,722 |

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 第9期中間計算期間 (自平成20年12月13日 至平成21年6月12日) | 第10期中間計算期間 (自平成21年12月15日 至平成22年6月14日) |
|---------------------------|--|--|
| 1 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(1) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券以外の有価証券 個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における中間計算期間末日の最終相場で評価しております。</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> | <p>(1) 投資信託受益証券 同 左</p> <p>(2) 投資信託受益証券以外の有価証券 同 左</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券 同 左</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同 左</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 同 左</p> |
| 2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | | <p>ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月12日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当中間計算期間は平成21年12月15日から平成22年6月14日までとなっております。</p> |

(中間貸借対照表に関する注記)

| | 第9期中間計算期間末 [平成21年6月12日現在] | 第10期中間計算期間末 [平成22年6月14日現在] |
|---|------------------------------|-------------------------------|
| 1 期首元本額 | 4,242,922,267円 | 4,192,057,328円 |
| 期中追加設定元本額 | 205,239,053円 | 173,799,902円 |
| 期中一部解約元本額 | 179,565,479円 | 195,792,496円 |
| 2 元本の欠損 中間貸借対照表上の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。 | 587,167,898円 | 617,333,722円 |
| 3 中間計算期間末日における受益権の総数 | 4,268,595,841口 | 4,170,064,734口 |
| 4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.8624円 (8,624円) | 0.8520円 (8,520円) |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(有価証券関係に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。[次へ](#)

（ご参考）

『三菱UFJ MV20』、『三菱UFJ MV40』及び『三菱UFJ MV80』の各ファンドは、ラッセルの設定・運用する追加型証券投資信託「ラッセル日本株式ファンド（適格機関投資家限定）」、「ラッセル外国株式ファンド（適格機関投資家限定）」、「ラッセル日本債券ファンド（適格機関投資家限定）」、「ラッセル外国債券ファンド Aコース（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）」及び「ラッセル外国債券ファンド Bコース（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）」の各受益証券を投資対象としており、三菱UFJ MV各ファンドの中間貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、すべて同各ファンドの受益証券であります。

同各ファンドの中間財務諸表は、次頁以下のとおりですが、それらは監査意見の対象外であります。

なお、各ファンドの中間財務諸表は、法令等に基づいて作成し、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。

中間財務諸表

ラッセル日本株式ファンド（適格機関投資家限定）

(1)中間貸借対照表

(単位：円)

| 区 分 | 前中間計算期間末 平成21年6月11日現在 | 当中間計算期間末 平成22年6月11日現在 |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|
| | 金 額 | 金 額 |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 親投資信託受益証券 | 11,182,713,770 | 9,786,149,395 |
| 未収入金 | 4,999,999 | 28,000,000 |
| 流動資産合計 | 11,187,713,769 | 9,814,149,395 |
| 資産合計 | 11,187,713,769 | 9,814,149,395 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 4,999,999 | 28,000,000 |
| 未払受託者報酬 | 3,467,430 | 3,456,413 |
| 未払委託者報酬 | 26,075,027 | 25,992,190 |
| 流動負債合計 | 34,542,456 | 57,448,603 |
| 負債合計 | 34,542,456 | 57,448,603 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 12,310,685,024 | 11,571,243,666 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 1,157,513,711 | 1,814,542,874 |
| (分配準備積立金) | 2,665,540,781 | 2,080,222,108 |
| 元本等合計 | 11,153,171,313 | 9,756,700,792 |
| 純資産合計 | 11,153,171,313 | 9,756,700,792 |
| 負債純資産合計 | 11,187,713,769 | 9,814,149,395 |

(2)中間損益及び剰余金計算書

(単位：円)

| 区 分 | 前中間計算期間 自平成20年12月12日 至平成21年6月11日 | 当中間計算期間 自平成21年12月12日 至平成22年6月11日 |
|---|--|--|
| | 金 額 | 金 額 |
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 1,941,864,254 | 50,027,732 |
| 営業収益合計 | 1,941,864,254 | 50,027,732 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 6,602,052 | 6,931,166 |
| 委託者報酬 | 49,647,345 | 52,122,337 |
| 営業費用合計 | 56,249,397 | 59,053,503 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 1,885,614,857 | 109,081,235 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 1,885,614,857 | 109,081,235 |
| 中間純利益又は中間純損失（ ） | 1,885,614,857 | 109,081,235 |
| 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（ ） | 66,773,142 | 105,209,614 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 3,221,894,047 | 1,763,182,847 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 698,683,266 | 272,877,609 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 698,683,266 | 272,877,609 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 453,144,645 | 109,946,787 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 453,144,645 | 109,946,787 |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 1,157,513,711 | 1,814,542,874 |

(3)中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区 分 | 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|-----------------|--|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 | 親投資信託受益証券 同左 |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | 前中間計算期間末 平成21年6月11日現在 | 当中間計算期間末 平成22年6月11日現在 |
|-----------------------|---|---|
| 1. 期首元本額 | 13,506,450,462円 | 12,728,964,840円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,677,144,654円 | 813,946,794円 |
| 期中一部解約元本額 | 2,872,910,092円 | 1,971,667,968円 |
| 2. 元本の欠損 | 中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,157,513,711円であります。 | 中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,814,542,874円であります。 |
| 3. 中間計算期間末日における受益権の総数 | 12,310,685,024口 | 11,571,243,666口 |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(有価証券に関する注記)

| 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(デリバティブ取引等に関する注記)

| 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(一口当たり情報に関する注記)

| 区 分 | 前中間計算期間末 平成21年6月11日現在 | 当中間計算期間末 平成22年6月11日現在 |
|---------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 一口当たり純資産額 (一万口当たり純資産額) | 0.9060円 (9,060円) | 0.8432円 (8,432円) |

（参考情報）

当ファンドは、「ラッセル 日本株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、同親投資信託の状況は次の通りです。

「ラッセル 日本株式マザーファンド」の状況

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)

| 区 分 | 平成21年6月11日現在 | 平成22年6月11日現在 |
|-------------|----------------|----------------|
| | 金 額 | 金 額 |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | 207,321 | 862,695 |
| コール・ローン | 3,495,517,885 | 2,932,990,815 |
| 株式 | 51,372,458,314 | 48,362,538,220 |
| 投資証券 | | 22,536,000 |
| 派生商品評価勘定 | 115,365,800 | 48,944,085 |
| 未収入金 | 654,846,198 | 471,592,723 |
| 未収配当金 | 325,648,842 | 373,855,245 |
| 未収利息 | 11,970 | 8,839 |
| 差入委託証拠金 | 368,378,800 | 118,569,715 |
| 流動資産合計 | 56,332,435,130 | 52,331,898,337 |
| 資産合計 | 56,332,435,130 | 52,331,898,337 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | 867,345,424 | 573,213,388 |
| 未払解約金 | 5,863,492 | 29,290,081 |
| 流動負債合計 | 873,208,916 | 602,503,469 |
| 負債合計 | 873,208,916 | 602,503,469 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 57,321,280,752 | 56,803,605,813 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 1,862,054,538 | 5,074,210,945 |
| 元本等合計 | 55,459,226,214 | 51,729,394,868 |
| 純資産合計 | 55,459,226,214 | 51,729,394,868 |
| 負債純資産合計 | 56,332,435,130 | 52,331,898,337 |

(注) 「ラッセル 日本株式マザーファンド」の計算期間は毎年4月19日より翌年4月18日までであり、当ファンドの計算期間と異なります。上記の貸借対照表は、平成21年6月11日及び平成22年6月11日における同親投資信託の状況であります。

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区 分 | 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|-----------------------|--|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>有価証券</p> <p>株式については移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の最終相場）で評価しております。 計算期間末日に当該金融商品取引所等の最終相場がない場合には、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でない認められた場合は、当該金融商品取引所等における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。 ・ 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融機関の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 ・ 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 | <p>有価証券</p> <p>株式及び投資証券については移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左 ・ 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左 ・ 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、取得価額または委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額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 | <p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> | <p>先物取引</p> <p>同左</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 平成21年6月11日現在 | 平成22年6月11日現在 |
|--|--|
| 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における 当該親投資信託の元本額 52,430,997,421円 期中追加設定元本額 11,503,579,468円 期中一部解約元本額 6,613,296,137円 元本の内訳 ラッセル 日本株式ファンド 987,477,820円 ラッセル 日本株式ファンド - 2 36,749,947,154円 ラッセル 日本株式ファンド (適格機関投資家限定) 11,558,360,486円 ラッセル 日本株式ファンド - 3 (適格機関投資家限定) 4,671,190,634円 ラッセル 日本株式マルチ・マネージャー・ファンド (確定拠出年金向け) 1,706,507,140円 ラッセル 日本株式ファンド - 4 (適格機関投資家限定) 1,043,364,466円 ラッセル グローバル・バランス・ファンド 安定型 36,963,198円 ラッセル グローバル・バランス・ファンド 安定・成長型 289,480,063円 ラッセル グローバル・バランス・ファンド 成長型 203,000,918円 ラッセル 日本株式マルチ・マネージャー・ファンド 74,988,873円 計 57,321,280,752円 | 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における 当該親投資信託の元本額 56,316,437,150円 期中追加設定元本額 4,583,294,798円 期中一部解約元本額 4,096,126,135円 元本の内訳 ラッセル 日本株式ファンド - 2 (適格機関投資家限定) 37,019,201,929円 ラッセル 日本株式ファンド (適格機関投資家限定) 10,745,744,368円 ラッセル 日本株式ファンド - 3 (適格機関投資家限定) 5,358,592,998円 ラッセル 日本株式マルチ・マネージャー・ファンド (確定拠出年金向け) 2,018,827,296円 ラッセル 日本株式ファンド - 4 (適格機関投資家限定) 1,034,593,493円 ラッセル グローバル・バランス・ファンド 安定型 39,007,401円 ラッセル グローバル・バランス・ファンド 安定・成長型 359,974,840円 ラッセル グローバル・バランス・ファンド 成長型 227,663,488円 計 56,803,605,813円 |
| 2. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その 差額は1,862,054,538円であります。 | 2. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その 差額は5,074,210,945円であります。 |
| 3. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に おける受益権の総数 57,321,280,752口 | 3. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に おける受益権の総数 56,803,605,813口 |

(有価証券に関する注記)

| 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|--------------------------------|--------------------------------|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連(平成21年6月11日現在)

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
|------|----------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 4,137,023,000 | | 4,252,930,000 | 115,907,000 |
| 合計 | | 4,137,023,000 | | 4,252,930,000 | 115,907,000 |

株式関連(平成22年6月11日現在)

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
|------|----------|---------------|-------|---------------|------------|
| | | | | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 3,369,306,915 | | 3,418,725,000 | 49,418,085 |
| 合計 | | 3,369,306,915 | | 3,418,725,000 | 49,418,085 |

(注) 1. 株価指数先物取引の評価方法

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場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、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、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。

4. 評価損益は、当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日までの期間の評価損益であります。

(一口当たり情報に関する注記)

| 区分 | 平成21年6月11日現在 | 平成22年6月11日現在 |
|---------------------------|---------------------|---------------------|
| 一口当たり純資産額 (一万口当たり純資産額) | 0.9675円 (9,675円) | 0.9107円 (9,107円) |

[次へ](#)

ラッセル 外国株式ファンド（適格機関投資家限定）

(1)中間貸借対照表

(単位：円)

| 区 分 | 前中間計算期間末 平成21年6月11日現在 | 当中間計算期間末 平成22年6月11日現在 |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|
| | 金 額 | 金 額 |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 親投資信託受益証券 | 4,337,407,859 | 3,876,765,919 |
| 未収入金 | 4,999,999 | 9,999,999 |
| 流動資産合計 | 4,342,407,858 | 3,886,765,918 |
| 資産合計 | 4,342,407,858 | 3,886,765,918 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 4,999,999 | 9,999,999 |
| 未払受託者報酬 | 1,350,024 | 1,341,313 |
| 未払委託者報酬 | 10,152,150 | 10,086,670 |
| 流動負債合計 | 16,502,173 | 21,427,982 |
| 負債合計 | 16,502,173 | 21,427,982 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 5,388,773,482 | 4,428,592,138 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 1,062,867,797 | 563,254,202 |
| (分配準備積立金) | 1,170,160,925 | 747,510,117 |
| 元本等合計 | 4,325,905,685 | 3,865,337,936 |
| 純資産合計 | 4,325,905,685 | 3,865,337,936 |
| 負債純資産合計 | 4,342,407,858 | 3,886,765,918 |

(2)中間損益及び剰余金計算書

(単位：円)

| 区 分 | 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|---|---|---|
| | 金 額 | 金 額 |
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 814,578,184 | 22,968,838 |
| 営業収益合計 | 814,578,184 | 22,968,838 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 2,546,460 | 2,669,524 |
| 委託者報酬 | 19,149,299 | 20,074,747 |
| 営業費用合計 | 21,695,759 | 22,744,271 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 792,882,425 | 224,567 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 792,882,425 | 224,567 |
| 中間純利益又は中間純損失（ ） | 792,882,425 | 224,567 |
| 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（ ） | 40,813,659 | 53,241,422 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 1,927,031,053 | 525,329,238 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 404,907,636 | 100,594,268 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 404,907,636 | 100,594,268 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 292,813,146 | 85,502,377 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 292,813,146 | 85,502,377 |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 1,062,867,797 | 563,254,202 |

(3)中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区 分 | 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|-----------------|--|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価して おります。 時価評価にあたっては、親投資信託 受益証券の基準価額に基づいて評 価しております。 | 親投資信託受益証券 同左 |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | 前中間計算期間末 平成21年6月11日現在 | 当中間計算期間末 平成22年6月11日現在 |
|------------------------------------|---|---|
| 1. 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額 | 5,740,054,286円 845,813,150円 1,197,093,954円 | 4,541,442,579円 758,502,384円 871,352,825円 |
| 2. 元本の欠損 | 中間貸借対照表上の純資産額が元本 総額を下回っており、その差額は 1,062,867,797円であります。 | 中間貸借対照表上の純資産額が元本 総額を下回っており、その差額は 563,254,202円であります。 |
| 3. 中間計算期間末日における受益権 の総数 | 5,388,773,482口 | 4,428,592,138口 |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(有価証券に関する注記)

| 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(デリバティブ取引等に関する注記)

| 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(一口当たり情報に関する注記)

| 区 分 | 前中間計算期間末 平成21年6月11日現在 | 当中間計算期間末 平成22年6月11日現在 |
|---------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 一口当たり純資産額 (一万口当たり純資産額) | 0.8028円 (8,028円) | 0.8728円 (8,728円) |

（参考情報）

当ファンドは、「ラッセル 外国株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、同親投資信託の状況は次の通りです。

「ラッセル 外国株式マザーファンド」の状況

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)

| 区 分 | 平成21年6月11日現在 | 平成22年6月11日現在 |
|-------------|----------------|----------------|
| | 金 額 | 金 額 |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 1,737,292,745 | 1,570,182,503 |
| コール・ローン | 569,420,819 | 826,943,212 |
| 株式 | 36,980,849,754 | 36,503,142,085 |
| 投資証券 | 92,447,415 | |
| 派生商品評価勘定 | 647,241,460 | 512,055,721 |
| 未収入金 | 171,151,676 | 490,498,329 |
| 未収配当金 | 49,102,143 | 49,654,008 |
| 未収利息 | 1,950 | 2,492 |
| 差入委託証拠金 | 746,325,652 | 321,107,034 |
| 流動資産合計 | 40,993,833,614 | 40,273,585,384 |
| 資産合計 | 40,993,833,614 | 40,273,585,384 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 613,716,245 | 491,232,359 |
| 未払金 | 481,522,501 | 480,194,022 |
| 未払解約金 | 5,092,764 | 24,527,573 |
| その他未払費用 | 5,560,000 | 5,818,791 |
| 流動負債合計 | 1,105,891,510 | 1,001,772,745 |
| 負債合計 | 1,105,891,510 | 1,001,772,745 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 49,885,414,409 | 44,674,935,640 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 9,997,472,305 | 5,403,123,001 |
| 元本等合計 | 39,887,942,104 | 39,271,812,639 |
| 純資産合計 | 39,887,942,104 | 39,271,812,639 |
| 負債純資産合計 | 40,993,833,614 | 40,273,585,384 |

（注）「ラッセル 外国株式マザーファンド」の計算期間は毎年4月19日より翌年4月18日までであり、当ファンドの計算期間と異なります。上記の貸借対照表は、平成21年6月11日及び平成22年6月11日における同親投資信託の状況であります。

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区 分 | 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|-----------------------|---|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>有価証券</p> <p>株式、カバード・ワラント及び投資証券については移動平均法、国債証券については個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の最終相場）で評価しております。計算期間末日に当該金融商品取引所等の最終相場がない場合には、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でないと認められた場合は、当該金融商品取引所等における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。 ・金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として日本証券業協会発表の店頭基準気配値段（ただし、社債券については、売買参考統計値（平均値））、金融機関の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 ・時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 | <p>有価証券</p> <p>株式については移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左 ・金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左 ・時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、取得価額または委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額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 | <p>(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は当該仲値、仲値が発表されていない場合には発表されている先物相場のうち受渡日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。</p> | <p>(1)先物取引 同左</p> <p>(2)為替予約取引 同左</p> |

| | | |
|----------------------------|---|------------------------------|
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「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）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>同左</p> |
|----------------------------|---|------------------------------|

(貸借対照表に関する注記)

| 平成21年6月11日現在 | | 平成22年6月11日現在 | |
|---|-----------------|---|-----------------|
| 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における | | 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における | |
| 当該親投資信託の元本額 | 40,745,002,427円 | 当該親投資信託の元本額 | 48,606,411,680円 |
| 期中追加設定元本額 | 14,912,817,191円 | 期中追加設定元本額 | 1,994,395,106円 |
| 期中一部解約元本額 | 5,772,405,209円 | 期中一部解約元本額 | 5,925,871,146円 |
| 元本の内訳 | | 元本の内訳 | |
| ラッセル 外国株式ファンド | 771,981,643円 | ラッセル 外国株式ファンド - 2 | |
| ラッセル 外国株式ファンド - 2 | 40,289,609,260円 | (適格機関投資家限定) | 36,484,237,568円 |
| ラッセル 外国株式ファンド | | ラッセル 外国株式ファンド | |
| (適格機関投資家限定) | 5,424,472,061円 | (適格機関投資家限定) | 4,409,925,969円 |
| ラッセル 外国株式ファンド - 4 A (為替ヘッジあり) | | ラッセル 外国株式ファンド - 4 A (為替ヘッジあり) | |
| (適格機関投資家限定) | 284,244,275円 | (適格機関投資家限定) | 355,833,004円 |
| ラッセル 外国株式ファンド - 4 B (為替ヘッジなし) | | ラッセル 外国株式ファンド - 4 B (為替ヘッジなし) | |
| (適格機関投資家限定) | 2,249,744,836円 | (適格機関投資家限定) | 2,500,236,550円 |
| ラッセル 外国株式マルチ・マネージャー・ファンド | | ラッセル 外国株式マルチ・マネージャー・ファンド | |
| (確定拠出年金向け) | 269,624,188円 | (確定拠出年金向け) | 433,696,686円 |
| ラッセル グローバル・バランス・ファンド | | ラッセル グローバル・バランス・ファンド | |
| 安定型 | 29,925,137円 | 安定型 | 25,312,429円 |
| ラッセル グローバル・バランス・ファンド | | ラッセル グローバル・バランス・ファンド | |
| 安定・成長型 | 237,560,776円 | 安定・成長型 | 254,258,756円 |
| ラッセル グローバル・バランス・ファンド | | ラッセル グローバル・バランス・ファンド | |
| 成長型 | 215,786,945円 | 成長型 | 211,434,678円 |
| ラッセル 外国株式マルチ・マネージャー・ファンド | | | |
| | 112,465,288円 | | |
| 計 | 49,885,414,409円 | 計 | 44,674,935,640円 |
| 2. 元本の欠損 | | 2. 元本の欠損 | |
| 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は9,997,472,305円であります。 | | 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は5,403,123,001円であります。 | |
| 3. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数 | | 3. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数 | |
| | 49,885,414,409口 | | 44,674,935,640口 |

(有価証券に関する注記)

| | |
|--------------------------------|--------------------------------|
| 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連(平成21年6月11日現在)

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
|------|----------|---------------|-------|---------------|------------|
| | | | | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 2,596,495,561 | | 2,585,955,516 | 10,540,045 |
| 合計 | | 2,596,495,561 | | 2,585,955,516 | 10,540,045 |

株式関連(平成22年6月11日現在)

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
|------|----------|---------------|-------|---------------|------------|
| | | | | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 2,575,529,047 | | 2,533,353,837 | 42,175,210 |
| 合計 | | 2,575,529,047 | | 2,533,353,837 | 42,175,210 |

(注)1. 株価指数先物取引の評価方法

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場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、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、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。また、契約額等及び時価の邦貨換算は計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っており、換算において円未満の端数は切り捨てております。

4. 評価損益は、当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日までの期間の評価損益であります。

通貨関連(平成21年6月11日現在)

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
|-----------|------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | | | | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売 建 | 27,050,872,749 | | 27,522,772,677 | 471,899,928 |
| | 米ドル | 14,603,139,328 | | 14,688,199,349 | 85,060,021 |
| | 加ドル | 1,105,955,306 | | 1,128,975,536 | 23,020,230 |
| | 豪ドル | 803,277,412 | | 827,524,045 | 24,246,633 |
| | 英債券 | 3,802,952,496 | | 3,982,547,947 | 179,595,451 |
| | スイスフラン | 1,351,617,298 | | 1,382,621,002 | 31,003,704 |
| | 香港ドル | 5,870,761 | | 5,880,865 | 10,104 |
| | シンガポールドル | 3,433,945 | | 3,483,460 | 49,515 |
| | ニュージーランドドル | 109,515,635 | | 116,530,885 | 7,015,250 |
| | スウェーデンクローネ | 1,292,776,010 | | 1,333,437,361 | 40,661,351 |
| | ノルウェークローネ | 14,544,504 | | 15,246,493 | 701,989 |
| | デンマーククローネ | 38,279,519 | | 38,679,008 | 399,489 |
| | ユーロ | 3,919,510,535 | | 3,999,646,726 | 80,136,191 |
| | 買 建 | 27,621,114,787 | | 28,121,837,938 | 500,723,151 |
| | 米ドル | 15,071,231,409 | | 15,193,363,808 | 122,132,399 |
| | 加ドル | 1,529,458,812 | | 1,568,187,904 | 38,729,092 |
| | 豪ドル | 969,968,496 | | 1,012,680,459 | 42,711,963 |
| | 英債券 | 3,291,257,146 | | 3,414,958,107 | 123,700,961 |
| | スイスフラン | 1,775,219,550 | | 1,828,498,458 | 53,278,908 |
| | 香港ドル | 2,464,115 | | 2,454,912 | 9,203 |
| | シンガポールドル | 1,516,503 | | 1,520,160 | 3,657 |
| | ニュージーランドドル | 64,386,523 | | 65,917,804 | 1,531,281 |
| | スウェーデンクローネ | 496,942,233 | | 498,200,210 | 1,257,977 |
| | ノルウェークローネ | 14,545,097 | | 15,247,106 | 702,009 |
| | デンマーククローネ | 74,755,293 | | 77,006,539 | 2,251,246 |
| | ユーロ | 4,329,369,610 | | 4,443,802,471 | 114,432,861 |
| | | 合 計 | 54,671,987,536 | | 55,644,610,615 |

通貨関連（平成22年6月11日現在）

（単位：円）

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|-----------|------------|----------------|-------|----------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売 建 | 22,154,568,500 | | 21,930,162,865 | 224,405,635 |
| | 米ドル | 12,170,303,264 | | 12,128,524,668 | 41,778,596 |
| | 加ドル | 898,574,783 | | 910,717,042 | 12,142,259 |
| | 豪ドル | 630,232,351 | | 635,727,409 | 5,495,058 |
| | 英ポンド | 1,543,645,303 | | 1,530,051,946 | 13,593,357 |
| | スイスフラン | 839,367,163 | | 834,166,650 | 5,200,513 |
| | 香港ドル | 456,089,386 | | 452,696,447 | 3,392,939 |
| | シンガポールドル | 33,346,994 | | 32,895,098 | 451,896 |
| | ニュージーランドドル | 6,576,297 | | 6,741,382 | 165,085 |
| | スウェーデンクローネ | 2,220,837,298 | | 2,151,890,354 | 68,946,944 |
| | ノルウェークローネ | 58,307,840 | | 58,910,528 | 602,688 |
| | デンマーククローネ | 86,850,328 | | 82,375,908 | 4,474,420 |
| | ユーロ | 3,210,437,493 | | 3,105,465,433 | 104,972,060 |
| | 買 建 | 23,016,696,820 | | 22,803,161,437 | 213,535,383 |
| | 米ドル | 12,346,850,071 | | 12,298,792,985 | 48,057,086 |
| | 加ドル | 1,634,056,944 | | 1,631,183,024 | 2,873,920 |
| | 豪ドル | 1,094,365,645 | | 1,062,511,101 | 31,854,544 |
| | 英ポンド | 1,896,238,889 | | 1,886,844,655 | 9,394,234 |
| | スイスフラン | 1,253,093,993 | | 1,208,958,057 | 44,135,936 |
| | 香港ドル | 542,775,112 | | 538,404,293 | 4,370,819 |
| | シンガポールドル | 107,355,127 | | 107,220,608 | 134,519 |
| | ニュージーランドドル | 10,799,442 | | 10,802,524 | 3,082 |
| | スウェーデンクローネ | 1,484,414,681 | | 1,488,431,984 | 4,017,303 |
| | ノルウェークローネ | 87,991,498 | | 85,015,102 | 2,976,396 |
| | デンマーククローネ | 50,930,090 | | 45,976,192 | 4,953,898 |
| | イスラエルシェケル | 32,484,989 | | 32,790,583 | 305,594 |
| | ユーロ | 2,475,340,339 | | 2,406,230,329 | 69,110,010 |
| | 合 計 | 45,171,265,320 | | 44,733,324,302 | 10,870,252 |

(注) 1. 為替予約の評価方法

(1) 計算期間末日に対顧客先物売買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。
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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仲値で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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先物相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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売買相場の仲値を用いております。

(2) 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 評価損益は、当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日までの期間の評価損益であります。

(一口当たり情報に関する注記)

| 区分 | 平成21年6月11日現在 | 平成22年6月11日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 一口当たり純資産額 | 0.7996円 | 0.8791円 |
| (一万口当たり純資産額) | (7,996円) | (8,791円) |

[前](#) [次](#)

ラッセル 日本債券ファンド（適格機関投資家限定）

(1)中間貸借対照表

(単位：円)

| 区 分 | 前中間計算期間末 平成21年6月11日現在 | 当中間計算期間末 平成22年6月11日現在 |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|
| | 金 額 | 金 額 |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 親投資信託受益証券 | 4,333,768,532 | 3,964,069,849 |
| 未収入金 | | 5,000,000 |
| 流動資産合計 | 4,333,768,532 | 3,969,069,849 |
| 資産合計 | 4,333,768,532 | 3,969,069,849 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | | 5,000,000 |
| 未払受託者報酬 | 1,096,357 | 1,088,248 |
| 未払委託者報酬 | 4,604,662 | 4,570,594 |
| 流動負債合計 | 5,701,019 | 10,658,842 |
| 負債合計 | 5,701,019 | 10,658,842 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 4,040,982,096 | 3,512,376,230 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 287,085,417 | 446,034,777 |
| （分配準備積立金） | 126,073,356 | 236,295,945 |
| 元本等合計 | 4,328,067,513 | 3,958,411,007 |
| 純資産合計 | 4,328,067,513 | 3,958,411,007 |
| 負債純資産合計 | 4,333,768,532 | 3,969,069,849 |

(2)中間損益及び剰余金計算書

(単位：円)

| 区 分 | 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|---|---|---|
| | 金 額 | 金 額 |
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 84,032,440 | 84,713,599 |
| 営業収益合計 | 84,032,440 | 84,713,599 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 2,175,149 | 2,172,966 |
| 委託者報酬 | 9,135,555 | 9,126,392 |
| 営業費用合計 | 11,310,704 | 11,299,358 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 72,721,736 | 73,414,241 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 72,721,736 | 73,414,241 |
| 中間純利益又は中間純損失（ ） | 72,721,736 | 73,414,241 |
| 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（ ） | 3,935,065 | 4,675,000 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 207,156,556 | 403,926,628 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 22,637,574 | 25,342,542 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 22,637,574 | 25,342,542 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 11,495,384 | 51,973,634 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 11,495,384 | 51,973,634 |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 287,085,417 | 446,034,777 |

(3)中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区 分 | 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|-----------------|--|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価して おります。 時価評価にあたっては、親投資信託 受益証券の基準価額に基づいて評価 しております。 | 親投資信託受益証券 同左 |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | 前中間計算期間末 平成21年6月11日現在 | 当中間計算期間末 平成22年6月11日現在 |
|---------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 1. 期首元本額 | 3,930,189,216円 | 3,768,070,118円 |
| 期中追加設定元本額 | 328,362,429円 | 228,657,462円 |
| 期中一部解約元本額 | 217,569,549円 | 484,351,350円 |
| 2. 中間計算期間末日における受益 権の総数 | 4,040,982,096口 | 3,512,376,230口 |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(有価証券に関する注記)

| 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(デリバティブ取引等に関する注記)

| 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(一口当たり情報に関する注記)

| 区 分 | 前中間計算期間末 平成21年6月11日現在 | 当中間計算期間末 平成22年6月11日現在 |
|---------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 一口当たり純資産額 (一万口当たり純資産額) | 1.0710円 (10,710円) | 1.1270円 (11,270円) |

（参考情報）

当ファンドは、「ラッセル 日本債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、同親投資信託の状況は次の通りです。

「ラッセル 日本債券マザーファンド」の状況

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）

| 区 分 | 平成21年6月11日現在 | 平成22年6月11日現在 |
|-------------|----------------|----------------|
| | 金 額 | 金 額 |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 1,134,965,883 | 799,436,452 |
| 国債証券 | 8,977,872,318 | 9,464,478,231 |
| 特殊債券 | 451,707,884 | 100,730,000 |
| 社債券 | 5,357,297,000 | 5,001,979,000 |
| 投資信託受益証券 | 595,334,839 | |
| 派生商品評価勘定 | | 511,690 |
| 未収入金 | 47,505,250 | 304,049,000 |
| 未収利息 | 50,278,169 | 43,203,068 |
| 前払費用 | 8,157,904 | 23,024,363 |
| 差入委託証拠金 | 60,986,850 | 1,538,310 |
| 流動資産合計 | 16,684,106,097 | 15,738,950,114 |
| 資産合計 | 16,684,106,097 | 15,738,950,114 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 1,970,425 | |
| 未払金 | 199,631,500 | 604,140,000 |
| 未払解約金 | | 5,000,000 |
| 流動負債合計 | 201,601,925 | 609,140,000 |
| 負債合計 | 201,601,925 | 609,140,000 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 14,627,450,301 | 12,691,860,323 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 1,855,053,871 | 2,437,949,791 |
| 元本等合計 | 16,482,504,172 | 15,129,810,114 |
| 純資産合計 | 16,482,504,172 | 15,129,810,114 |
| 負債純資産合計 | 16,684,106,097 | 15,738,950,114 |

（注）「ラッセル 日本債券マザーファンド」の計算期間は毎年11月19日より翌年11月18日までであり、当ファンドの計算期間と異なります。上記の貸借対照表は、平成21年6月11日及び平成22年6月11日における同親投資信託の状況であります。

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区 分 | 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|-----------------------|---|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>有価証券 投資信託受益証券については移動平均法、それ以外の有価証券については個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の最終相場）で評価しております。 計算期間末日に当該金融商品取引所等の最終相場がない場合には、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でないと認められた場合は、当該金融商品取引所等における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。 ・金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融機関の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 ・時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 | <p>有価証券 同左</p> <ul style="list-style-type: none"> ・金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左 ・金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左 ・時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、取得価額または委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額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 | <p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> | <p>先物取引 同左</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 平成21年6月11日現在 | | 平成22年6月11日現在 | |
|--|-----------------|--|-----------------|
| 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における | | 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における | |
| 当該親投資信託の元本額 | 14,366,904,931円 | 当該親投資信託の元本額 | 13,251,526,293円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,474,988,160円 | 期中追加設定元本額 | 801,626,858円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,214,442,790円 | 期中一部解約元本額 | 1,361,292,828円 |
| 元本の内訳 | | 元本の内訳 | |
| ラッセル 世界債券ファンド | 380,870,590円 | ラッセル 日本債券ファンド | |
| ラッセル 日本債券ファンド | | (適格機関投資家限定) | 3,325,282,988円 |
| (適格機関投資家限定) | 3,846,084,960円 | ラッセル 日本債券ファンド - 2 | |
| ラッセル 日本債券ファンド - 2 | | (適格機関投資家限定) | 2,413,281,962円 |
| (適格機関投資家限定) | 3,483,393,190円 | ラッセル 日本債券ファンド | |
| ラッセル 日本債券ファンド | | (適格機関投資家限定) | 3,470,797,931円 |
| (適格機関投資家限定) | 4,066,567,209円 | ラッセル 日本債券ファンド - 1 | |
| ラッセル 日本債券ファンド - 1 | | (適格機関投資家限定) | 3,403,271,109円 |
| (適格機関投資家限定) | 2,790,881,393円 | ラッセル グローバル・バランス・ファンド | |
| ラッセル グローバル・バランス・ファンド | | 安定型 | 10,324,508円 |
| 安定型 | 9,167,977円 | ラッセル グローバル・バランス・ファンド | |
| ラッセル グローバル・バランス・ファンド | | 安定・成長型 | 46,968,282円 |
| 安定・成長型 | 33,076,001円 | ラッセル グローバル・バランス・ファンド | |
| ラッセル グローバル・バランス・ファンド | | 成長型 | 21,933,543円 |
| 成長型 | 17,408,981円 | | |
| 計 | 14,627,450,301円 | 計 | 12,691,860,323円 |
| 2. 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の通り差入を行っております。 | | 2. | |
| 国債証券 | 30,453,600円 | | |
| 3. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数 | | 3. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数 | |
| | 14,627,450,301口 | | 12,691,860,323口 |

(有価証券に関する注記)

| 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|--------------------------------|--------------------------------|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

債券関連(平成21年6月11日現在)

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
|------|--------|-------------|-------|-------------|-----------|
| | | | | | |
| 市場取引 | 債券先物取引 | | | | |
| | 買建 | 815,500,000 | | 813,540,000 | 1,960,000 |
| 合計 | | 815,500,000 | | 813,540,000 | 1,960,000 |

債券関連(平成22年6月11日現在)

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
|------|--------|-------------|-------|-------------|---------|
| | | | | | |
| 市場取引 | 債券先物取引 | | | | |
| | 買建 | 196,186,000 | | 196,700,000 | 514,000 |
| 合計 | | 196,186,000 | | 196,700,000 | 514,000 |

(注)1. 債券先物取引の評価方法

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場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、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 債券先物取引の残高は、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。

4. 評価損益は、当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日までの期間の評価損益であります。

(一口当たり情報に関する注記)

| 区分 | 平成21年6月11日現在 | 平成22年6月11日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 一口当たり純資産額 | 1.1268円 | 1.1921円 |
| (一万口当たり純資産額) | (11,268円) | (11,921円) |

[前へ](#) [次へ](#)

ラッセル 外国債券ファンド Aコース（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）

(1) 中間貸借対照表

(単位：円)

| 区 分 | 前中間計算期間末 平成21年6月11日現在 | 当中間計算期間末 平成22年6月11日現在 |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|
| | 金 額 | 金 額 |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 親投資信託受益証券 | 3,840,607,067 | 3,372,131,177 |
| 派生商品評価勘定 | 3,916,031 | 36,921,786 |
| 未収入金 | | 7,999,999 |
| 流動資産合計 | 3,844,523,098 | 3,417,052,962 |
| 資産合計 | 3,844,523,098 | 3,417,052,962 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 180,235,289 | 8,588,182 |
| 未払解約金 | | 7,999,999 |
| 未払受託者報酬 | 948,316 | 933,353 |
| 未払委託者報酬 | 7,112,346 | 7,000,098 |
| 流動負債合計 | 188,295,951 | 24,521,632 |
| 負債合計 | 188,295,951 | 24,521,632 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 3,311,469,080 | 2,730,136,758 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 344,758,067 | 662,394,572 |
| （分配準備積立金） | 193,787,385 | 356,047,172 |
| 元本等合計 | 3,656,227,147 | 3,392,531,330 |
| 純資産合計 | 3,656,227,147 | 3,392,531,330 |
| 負債純資産合計 | 3,844,523,098 | 3,417,052,962 |

(2) 中間損益及び剰余金計算書

(単位：円)

| 区 分 | 前中間計算期間 自平成20年12月12日 至平成21年6月11日 | 当中間計算期間 自平成21年12月12日 至平成22年6月11日 |
|---|--|--|
| | 金 額 | 金 額 |
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 469,376,510 | 56,198,740 |
| 為替差損益 | 438,805,558 | 240,206,425 |
| 営業収益合計 | 30,570,952 | 184,007,685 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 1,880,648 | 1,864,874 |
| 委託者報酬 | 14,104,790 | 13,986,500 |
| 営業費用合計 | 15,985,438 | 15,851,374 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 14,585,514 | 168,156,311 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 14,585,514 | 168,156,311 |
| 中間純利益又は中間純損失（ ） | 14,585,514 | 168,156,311 |
| 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（ ） | 4,268,070 | 16,251,490 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 330,705,301 | 557,056,772 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 34,198,508 | 48,917,746 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 34,198,508 | 48,917,746 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 30,463,186 | 95,484,767 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 30,463,186 | 95,484,767 |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 344,758,067 | 662,394,572 |

(3)中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|-----------------------|---|---|
| 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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 | 親投資信託受益証券 同左 |
| 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 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合には当該仲値、仲値が発表されていない場合には発表されている先物相場のうち受渡日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。 | 為替予約取引 同左 |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 前中間計算期間末 平成21年6月11日現在 | 当中間計算期間末 平成22年6月11日現在 |
|---------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 1. 期首元本額 | 3,308,936,324円 | 2,996,318,227円 |
| 期中追加設定元本額 | 306,801,497円 | 247,082,261円 |
| 期中一部解約元本額 | 304,268,741円 | 513,263,730円 |
| 2. 中間計算期間末日における 受益権の総数 | 3,311,469,080口 | 2,730,136,758口 |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|---|---|
| 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 1,773,636円 | 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、当該委託を受けた者と委託者の間で別に定める取決めに基づく金額を、委託者報酬の中から支弁しております。 |

(有価証券に関する注記)

| 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連 前中間計算期間末(平成21年6月11日現在)

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | うち | 時価 | 評価損益 |
|-----------|------------|---------------|-----|---------------|-------------|
| | | | 1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | 3,814,080,709 | | 3,994,288,313 | 180,207,604 |
| | 米ドル | 1,200,080,709 | | 1,240,254,206 | 40,173,497 |
| | 加ドル | 97,020,290 | | 103,536,435 | 6,516,145 |
| | 豪ドル | 21,503,651 | | 23,127,052 | 1,623,401 |
| | 英ポンド | 362,146,102 | | 389,656,368 | 27,510,266 |
| | スイスフラン | 28,313,866 | | 29,865,172 | 1,551,306 |
| | シンガポールドル | 36,157,499 | | 37,572,453 | 1,414,954 |
| | スウェーデンクローネ | 38,557,346 | | 39,335,872 | 778,526 |
| | ユーロ | 2,030,301,246 | | 2,130,940,755 | 100,639,509 |
| | 買建 | 102,066,536 | | 105,954,882 | 3,888,346 |
| | 米ドル | 34,638,617 | | 35,734,980 | 1,096,363 |
| | 加ドル | 1,029,339 | | 1,084,036 | 54,697 |
| | 豪ドル | 212,875 | | 228,252 | 15,377 |
| | 英ポンド | 41,294,962 | | 43,213,341 | 1,918,379 |
| | スイスフラン | 629,893 | | 645,048 | 15,155 |
| | シンガポールドル | 879,678 | | 911,380 | 31,702 |
| | スウェーデンクローネ | 1,711,915 | | 1,687,361 | 24,554 |
| | ユーロ | 21,669,257 | | 22,450,484 | 781,227 |
| | 合計 | 3,916,147,245 | | 4,100,243,195 | 176,319,258 |

通貨関連 当中間計算期間末(平成22年6月11日現在)

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | うち | 時価 | 評価損益 |
|-----------|------------|---------------|-----|---------------|------------|
| | | | 1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | 3,653,878,411 | | 3,625,176,082 | 28,702,329 |
| | 米ドル | 1,439,655,194 | | 1,431,895,149 | 7,760,045 |
| | 加ドル | 110,044,167 | | 110,264,123 | 219,956 |
| | 豪ドル | 32,716,623 | | 32,113,317 | 603,306 |
| | 英債券 | 259,869,012 | | 264,841,646 | 4,972,634 |
| | スイスフラン | 20,700,311 | | 20,643,503 | 56,808 |
| | シンガポールドル | 33,655,416 | | 33,312,464 | 342,952 |
| | スウェーデンクローネ | 36,584,482 | | 36,125,574 | 458,908 |
| | ユーロ | 1,720,653,206 | | 1,695,980,306 | 24,672,900 |
| | 買建 | 252,493,121 | | 252,124,396 | 368,725 |
| | 米ドル | 83,996,439 | | 84,531,484 | 535,045 |
| | 加ドル | 6,655,050 | | 6,831,026 | 175,976 |
| | 豪ドル | 2,067,011 | | 2,084,274 | 17,263 |
| | 英債券 | 16,336,679 | | 16,616,796 | 280,117 |
| | スイスフラン | 1,795,600 | | 1,821,007 | 25,407 |
| | シンガポールドル | 2,046,625 | | 2,058,209 | 11,584 |
| | スウェーデンクローネ | 6,068,313 | | 6,036,408 | 31,905 |
| | ユーロ | 133,527,404 | | 132,145,192 | 1,382,212 |
| | 合計 | 3,906,371,532 | | 3,877,300,478 | 28,333,604 |

(注) 1. 為替予約の評価方法

(1) 中間計算期間末日に対顧客先物売買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。

中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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仲値で評価しております。

中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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。

- ・ 中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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売買相場の仲値を用いております。

(2) 中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

(一口当たり情報に関する注記)

| 区分 | 前中間計算期間末 平成21年6月11日現在 | 当中間計算期間末 平成22年6月11日現在 |
|---------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 一口当たり純資産額 (一万口当たり純資産額) | 1.1041円 (11,041円) | 1.2426円 (12,426円) |

[前へ](#) [次へ](#)

ラッセル 外国債券ファンド Bコース（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）

(1)中間貸借対照表

(単位：円)

| 区 分 | 前中間計算期間末 平成21年6月11日現在 | 当中間計算期間末 平成22年6月11日現在 |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|
| | 金 額 | 金 額 |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 親投資信託受益証券 | 781,224,773 | 713,137,594 |
| 流動資産合計 | 781,224,773 | 713,137,594 |
| 資産合計 | 781,224,773 | 713,137,594 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払受託者報酬 | 196,510 | 196,392 |
| 未払委託者報酬 | 1,473,811 | 1,472,883 |
| 流動負債合計 | 1,670,321 | 1,669,275 |
| 負債合計 | 1,670,321 | 1,669,275 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 478,079,981 | 445,260,331 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 301,474,471 | 266,207,988 |
| （分配準備積立金） | 180,764,896 | 155,452,237 |
| 元本等合計 | 779,554,452 | 711,468,319 |
| 純資産合計 | 779,554,452 | 711,468,319 |
| 負債純資産合計 | 781,224,773 | 713,137,594 |

(2)中間損益及び剰余金計算書

(単位：円)

| 区 分 | 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|---|---|---|
| | 金 額 | 金 額 |
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 94,632,595 | 11,309,860 |
| 営業収益合計 | 94,632,595 | 11,309,860 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 383,538 | 390,340 |
| 委託者報酬 | 2,876,472 | 2,927,469 |
| 営業費用合計 | 3,260,010 | 3,317,809 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 91,372,585 | 14,627,669 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 91,372,585 | 14,627,669 |
| 中間純利益又は中間純損失（ ） | 91,372,585 | 14,627,669 |
| 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（ ） | 4,904,315 | 233,572 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 217,502,217 | 286,267,858 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 23,074,336 | 16,776,712 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 23,074,336 | 16,776,712 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 25,570,352 | 21,975,341 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 25,570,352 | 21,975,341 |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 301,474,471 | 266,207,988 |

(3)中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区 分 | 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|-----------------|--|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 | 親投資信託受益証券 同左 |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | 前中間計算期間末 平成21年6月11日現在 | 当中間計算期間末 平成22年6月11日現在 |
|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 1.期首元本額 | 489,679,642円 | 453,828,125円 |
| 期中追加設定元本額 | 45,925,670円 | 26,223,291円 |
| 期中一部解約元本額 | 57,525,331円 | 34,791,085円 |
| 2.中間計算期間末日における 受益権の総数 | 478,079,981口 | 445,260,331口 |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(有価証券に関する注記)

| 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(デリバティブ取引等に関する注記)

| 前中間計算期間 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 当中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(一口当たり情報に関する注記)

| 区 分 | 前中間計算期間末 平成21年6月11日現在 | 当中間計算期間末 平成22年6月11日現在 |
|---------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 一口当たり純資産額 (一万口当たり純資産額) | 1.6306円 (16,306円) | 1.5979円 (15,979円) |

（参考情報）

「ラッセル 外国債券ファンド Aコース（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）」及び「ラッセル 外国債券ファンド Bコース（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）」は、「ラッセル 外国債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、同親投資信託の状況は次の通りです。

「ラッセル 外国債券マザーファンド」の状況

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)

| 区 別 | 平成21年6月11日現在 | 平成22年6月11日現在 |
|--------------|----------------|----------------|
| | 金 額 | 金 額 |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 182,948,777 | 205,238,590 |
| コール・ローン | 320,001,593 | 355,744,193 |
| 国債証券 | 5,274,563,299 | 7,303,808,065 |
| 地方債証券 | 372,905,615 | 220,349,283 |
| 特殊債券 | 5,256,809,437 | 1,649,718,326 |
| 社債券 | 3,777,557,111 | 4,064,260,019 |
| 派生商品評価勘定 | 186,550,742 | 310,114,370 |
| 未収入金 | 3,378,131,074 | 54,996,534 |
| 未収利息 | 137,791,883 | 157,840,824 |
| 前払費用 | 39,704,102 | 35,349,530 |
| 差入委託証拠金 | 292,029,957 | 189,808,325 |
| 流動資産合計 | 19,218,993,590 | 14,547,228,059 |
| 資産合計 | 19,218,993,590 | 14,547,228,059 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| プット・オプション（売） | 12,277 | 219,152 |
| 派生商品評価勘定 | 287,699,193 | 184,373,237 |
| 未払金 | 6,430,980,864 | 36,665,910 |
| 未払解約金 | | 13,589,531 |
| その他未払費用 | 1,899,000 | 1,091,602 |
| 流動負債合計 | 6,720,591,334 | 235,939,432 |
| 負債合計 | 6,720,591,334 | 235,939,432 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 6,544,702,245 | 7,578,750,878 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 5,953,700,011 | 6,732,537,749 |
| 元本等合計 | 12,498,402,256 | 14,311,288,627 |
| 純資産合計 | 12,498,402,256 | 14,311,288,627 |
| 負債純資産合計 | 19,218,993,590 | 14,547,228,059 |

（注）「ラッセル 外国債券マザーファンド」の計算期間は毎年3月14日より翌年3月13日までであり、当ファンドの計算期間と異なります。上記の貸借対照表は、平成21年6月11日及び平成22年6月11日における同親投資信託の状況であります。

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区 別 | 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|-----------------------|---|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>有価証券 組入有価証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <ul style="list-style-type: none"> 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の最終相場）で評価しております。 計算期間末日に当該金融商品取引所等の最終相場がない場合には、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でないと認められた場合は、当該金融商品取引所等における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融機関の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。 | <p>有価証券 同左</p> <ul style="list-style-type: none"> 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、取得価額または委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額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 | <p>(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は当該仲値、仲値が発表されていない場合には発表されている先物相場のうち受渡日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。</p> <p>(3)オプション取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する証拠金算定基準値段、最終相場又は金融商品取引業者等の提示する価額によって評価しております。</p> | <p>(1)先物取引 同左</p> <p>(2)為替予約取引 同左</p> <p>(3)オプション取引 同左</p> |

| | | |
|----------------------------|--|-------------------|
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。 | 外貨建取引等の処理基準 同左 |
|----------------------------|--|-------------------|

(貸借対照表に関する注記)

| 平成21年6月11日現在 | | 平成22年6月11日現在 | |
|--|----------------|--|----------------|
| 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における | | 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における | |
| 当該親投資信託の元本額 | 6,930,768,868円 | 当該親投資信託の元本額 | 8,018,681,776円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,006,885,276円 | 期中追加設定元本額 | 1,063,126,131円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,392,951,899円 | 期中一部解約元本額 | 1,503,057,029円 |
| 元本の内訳 | | 元本の内訳 | |
| ラッセル 世界債券ファンド | 550,936,203円 | ラッセル 外国債券ファンド | |
| ラッセル 外国債券ファンド | | Aコース（為替ヘッジあり） | |
| Aコース（為替ヘッジあり） | | （適格機関投資家限定） | 1,785,802,668円 |
| （適格機関投資家限定） | 2,011,104,921円 | ラッセル 外国債券ファンド | |
| ラッセル 外国債券ファンド | | Bコース（為替ヘッジなし） | |
| Bコース（為替ヘッジなし） | | （適格機関投資家限定） | 377,661,174円 |
| （適格機関投資家限定） | 409,082,460円 | ラッセル 外国債券ファンド - 2 | |
| ラッセル 外国債券ファンド - 2 | | （適格機関投資家限定） | 2,748,189,121円 |
| （適格機関投資家限定） | 659,021,485円 | ラッセル 外国債券ファンド | |
| ラッセル 外国債券ファンド | | Aコース（為替ヘッジあり） | |
| Aコース（為替ヘッジあり） | | （適格機関投資家限定） | 1,833,335,808円 |
| （適格機関投資家限定） | 2,098,126,140円 | ラッセル 外国債券ファンド | |
| ラッセル 外国債券ファンド | | Bコース（為替ヘッジなし） | |
| Bコース（為替ヘッジなし） | | （適格機関投資家限定） | 427,722,409円 |
| （適格機関投資家限定） | 471,816,363円 | ラッセル グローバル・バランス・ファンド | |
| ラッセル グローバル・バランス・ファンド | | 安定型 | 89,001,538円 |
| 安定型 | 83,719,999円 | ラッセル グローバル・バランス・ファンド | |
| ラッセル グローバル・バランス・ファンド | | 安定・成長型 | 261,504,864円 |
| 安定・成長型 | 212,123,005円 | ラッセル グローバル・バランス・ファンド | |
| ラッセル グローバル・バランス・ファンド | | 成長型 | 55,533,296円 |
| 成長型 | 48,771,669円 | | |
| 計 | 6,544,702,245円 | 計 | 7,578,750,878円 |
| 2. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数 | | 2. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数 | |
| | 6,544,702,245口 | | 7,578,750,878口 |

(有価証券に関する注記)

| 自 平成20年12月12日 至 平成21年 6月11日 | 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日 |
|--------------------------------|--------------------------------|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

債券関連（平成21年6月11日現在）

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
|------|--------|-------------|-------|-------------|-----------|
| | | | | | |
| 市場取引 | 債券先物取引 | | | | |
| | 買建 | 398,192,857 | - | 396,232,613 | 1,960,244 |

| | | | | |
|-----|-------------|---|-------------|-----------|
| 合 計 | 398,192,857 | - | 396,232,613 | 1,960,244 |
|-----|-------------|---|-------------|-----------|

債券関連 (平成22年6月11日現在)

(単位:円)

| 区分 | 種 類 | 契約額等 | | 時 価 | 評価損益 |
|------|------------------|----------------------------|------------|---------------|-----------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 債券先物取引 買 建 | 2,635,774,775 | - | 2,628,200,935 | 7,573,840 |
| | 債券オプション取引 売 建 | 97,766,055 (358,888) | - (-) | 219,152 | 139,736 |
| | プット | 97,766,055 (358,888) | - (-) | 219,152 | 139,736 |
| | 合 計 | 2,733,540,830 (358,888) | - (-) | 2,628,420,087 | 7,434,104 |

(注) 1. 債券先物取引

(1) 債券先物取引の評価方法

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場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、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(2) 債券先物取引の残高は、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。また、契約額等及び時価の邦貨換算は計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っており、換算において円未満の端数は切り捨てております。

(4) 評価損益は、当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日までの期間の評価損益であります。

2. 債券オプション取引

(1) 債券オプション取引の評価方法

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する証拠金算定基準値段、最終相場又は金融商品取引業者等の提示する価額により評価しております。

(2) 換算において、円未満の端数は切り捨てております。

(3) オプション取引における()は、受取オプション料であります。

(4) 評価損益は、当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日までの期間の評価損益であります。

金利関連（平成21年6月11日現在）

（単位：円）

| 区分 | 種類 | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
|------|--------|---------------|---------------|---------------|------------|
| | | | | | |
| 市場取引 | 金利先物取引 | | | | |
| | 買建 | 6,005,705,110 | 6,005,705,110 | 5,986,381,563 | 19,323,547 |
| 合計 | | 6,005,705,110 | 6,005,705,110 | 5,986,381,563 | 19,323,547 |

金利関連（平成22年6月11日現在）

（単位：円）

| 区分 | 種類 | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
|------|--------|---------------|---------------|---------------|------------|
| | | | | | |
| 市場取引 | 金利先物取引 | | | | |
| | 買建 | 4,468,696,579 | 4,468,696,579 | 4,498,968,909 | 30,272,330 |
| 合計 | | 4,468,696,579 | 4,468,696,579 | 4,498,968,909 | 30,272,330 |

（注）1．金利先物取引の評価方法

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場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、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2．金利先物取引の残高は、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。また契約額等及び時価の邦貨換算は計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っており、換算において円未満の端数は切り捨てております。

4．評価損益は、当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日までの期間の評価損益であります。

通貨関連（平成21年6月11日現在）

（単位：円）

| 区分 | 種類 | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
|------|-----------------|----------------------------|------------------------|---------------|------------|
| | | | | | |
| 市場取引 | 通貨先物取引 | | | | |
| | 買建 | 5,473,988,446 | 5,473,988,446 | 5,448,504,040 | 25,484,406 |
| | 通貨オプション取引 売建 | 483,733,500 (883,980) | - (-) | 12,277 | 871,703 |
| | プット | 483,733,500 (883,980) | - (-) | 12,277 | 871,703 |
| 合計 | | 5,957,721,946 (883,980) | 5,473,988,446 (-) | 5,448,516,317 | 24,612,703 |

通貨関連（平成22年6月11日現在）

該当事項はありません。

（注）1．通貨先物取引

（1）通貨先物取引の評価方法

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場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、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

（2）通貨先物取引の残高は、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。また、契約額等及び時価の邦貨換算は計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っており、換算において円未満の端数は切り捨てております。

（4）評価損益は、当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日までの期間の評価損益であります。

2．通貨オプション取引

（1）通貨オプション取引の評価方法

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する証拠金算定基準値段、最終相場又は金融商品取引業者等の提示する価額により評価しております。

（2）換算において、円未満の端数は切り捨てております。

（3）オプション取引における（ ）は、受取オプション料であります。

（4）評価損益は、当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日までの期間の評価損益であります。

通貨関連（平成21年6月11日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等 | うち | 時価 | 評価損益 |
|-----------|------------|----------------|-----|----------------|-------------|
| | | | 1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | 6,568,378,801 | - | 6,790,107,661 | 221,728,860 |
| | 米ドル | 2,885,852,602 | - | 2,941,031,974 | 55,179,372 |
| | 加ドル | 295,911,200 | - | 304,275,300 | 8,364,100 |
| | 豪ドル | 983,554,200 | - | 1,045,666,150 | 62,111,950 |
| | 英ポンド | 344,955,620 | - | 358,467,200 | 13,511,580 |
| | ニュージーランドドル | 658,350,000 | - | 714,598,500 | 56,248,500 |
| | スウェーデンクローネ | 3,150,000 | - | 3,177,500 | 27,500 |
| | デンマーククローネ | 57,526,200 | - | 58,671,000 | 1,144,800 |
| | メキシコペソ | 295,786,400 | - | 288,879,300 | 6,907,100 |
| | ハンガリーフォリント | 94,411,200 | - | 99,507,200 | 5,096,000 |
| | ポーランドズロチ | 321,420,000 | - | 333,300,000 | 11,880,000 |
| | 南アフリカランド | 353,585 | - | 393,765 | 40,180 |
| | ユーロ | 627,107,794 | - | 642,139,772 | 15,031,978 |
| | 買建 | 6,568,498,201 | - | 6,735,846,808 | 167,348,607 |
| | 米ドル | 3,600,958,985 | - | 3,657,642,386 | 56,683,401 |
| | 加ドル | 14,890,889 | - | 15,080,570 | 189,681 |
| | 豪ドル | 29,719,659 | - | 30,324,480 | 604,821 |
| | 英ポンド | 537,806,521 | - | 584,084,380 | 46,277,859 |
| | スイスフラン | 96,699,132 | - | 98,172,420 | 1,473,288 |
| | シンガポールドル | 53,444,237 | - | 54,411,706 | 967,469 |
| | ニュージーランドドル | 6,555,027 | - | 6,805,700 | 250,673 |
| | スウェーデンクローネ | 406,928,112 | - | 422,528,210 | 15,600,098 |
| | ノルウェークローネ | 219,641,501 | - | 228,749,170 | 9,107,669 |
| | ポーランドズロチ | 18,208,714 | - | 18,995,876 | 787,162 |
| | ユーロ | 1,583,645,424 | - | 1,619,051,910 | 35,406,486 |
| | 合計 | 13,136,877,002 | - | 13,525,954,469 | 54,380,253 |

通貨関連（平成22年6月11日現在）

（単位：円）

| 区分 | 種類 | 契約額等 | うち | 時価 | 評価損益 |
|-----------|------------|----------------|-----|----------------|-------------|
| | | | 1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | 7,118,214,170 | - | 6,890,280,511 | 227,933,659 |
| | 米ドル | 2,778,069,820 | - | 2,768,501,721 | 9,568,099 |
| | 加ドル | 104,006,410 | - | 101,876,540 | 2,129,870 |
| | 豪ドル | 950,914,590 | - | 945,656,620 | 5,257,970 |
| | 英ポンド | 442,209,320 | - | 434,659,680 | 7,549,640 |
| | ニュージーランドドル | 827,216,500 | - | 773,270,300 | 53,946,200 |
| | ノルウェークローネ | 108,385,200 | - | 106,411,800 | 1,973,400 |
| | メキシコペソ | 199,495,500 | - | 191,440,500 | 8,055,000 |
| | ポーランドズロチ | 426,155,000 | - | 390,340,000 | 35,815,000 |
| | ユーロ | 1,281,761,830 | - | 1,178,123,350 | 103,638,480 |
| | 買建 | 7,135,430,755 | - | 7,009,763,152 | 125,667,603 |
| | 米ドル | 4,373,024,350 | - | 4,318,997,842 | 54,026,508 |
| | 加ドル | 52,323,848 | - | 54,091,380 | 1,767,532 |
| | 豪ドル | 18,108,102 | - | 18,299,440 | 191,338 |
| | 英ポンド | 587,584,440 | - | 570,010,860 | 17,573,580 |
| | スイスフラン | 92,208,501 | - | 92,733,550 | 525,049 |
| | シンガポールドドル | 381,130,640 | - | 375,491,086 | 5,639,554 |
| | スウェーデンクローネ | 362,994,378 | - | 345,401,800 | 17,592,578 |
| | ノルウェークローネ | 175,183,974 | - | 166,083,000 | 9,100,974 |
| | デンマーククローネ | 48,310,432 | - | 47,833,520 | 476,912 |
| | ポーランドズロチ | 22,438,439 | - | 19,068,434 | 3,370,005 |
| | ユーロ | 1,022,123,651 | - | 1,001,752,240 | 20,371,411 |
| | 合計 | 14,253,644,925 | - | 13,900,043,663 | 102,266,056 |

(注) 1. 為替予約の評価方法

- (1) 計算期間末日に対顧客先物売買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。
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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仲値で評価しております。
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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。
 ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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先物相場の仲値をもとに計算しております。
 ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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売買相場の仲値を用いております。

(2) 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 評価損益は、当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日までの期間の評価損益であります。

(一口当たり情報に関する注記)

| 区分 | 平成21年6月11日現在 | 平成22年6月11日現在 |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 一口当たり純資産額 (一万口当たり純資産額) | 1.9097円 (19,097円) | 1.8883円 (18,883円) |

[前へ](#)

2【ファンドの現況】

<更新後>

「三菱UFJ MV20」

【純資産額計算書】

平成22年6月30日現在

(単位:円)

| | |
|-----------------|-----------------------------|
| 資産総額 | 5,219,734,963 |
| 負債総額 | 3,616,552 |
| 純資産総額(-) | 5,216,118,411 |
| 発行済口数 | 5,126,001,416 口 |
| 1口当たり純資産価額(/) | 1.0176 (1万口当たり 10,176) |

「三菱UFJ MV40」

純資産額計算書

平成22年6月30日現在

(単位:円)

| | |
|-----------------|----------------------------|
| 資産総額 | 5,312,498,069 |
| 負債総額 | 4,205,393 |
| 純資産総額(-) | 5,308,292,676 |
| 発行済口数 | 5,521,708,592 口 |
| 1口当たり純資産価額(/) | 0.9613 (1万口当たり 9,613) |

「三菱UFJ MV80」

純資産額計算書

平成22年6月30日現在

(単位:円)

| | |
|-----------------|----------------------------|
| 資産総額 | 3,455,337,559 |
| 負債総額 | 6,598,712 |
| 純資産総額(-) | 3,448,738,847 |
| 発行済口数 | 4,157,599,878 口 |
| 1口当たり純資産価額(/) | 0.8295 (1万口当たり 8,295) |

[次へ](#)

(ご参考)

『三菱UFJ MV20』、『三菱UFJ MV40』及び『三菱UFJ MV80』の各ファンドは、ラッセルの設定・運用する追加型証券投資信託「ラッセル日本株式ファンド(適格機関投資家限定)」、「ラッセル外国株式ファンド(適格機関投資家限定)」、「ラッセル日本債券ファンド(適格機関投資家限定)」、「ラッセル外国債券ファンド Aコース(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)」及び「ラッセル外国債券ファンド Bコース(為替ヘッジなし)(適格機関投資家限定)」の各ファンドを投資対象としております。

また、前記ラッセルの設定・運用する各ファンドは、同じく同社の設定・運用する親投資信託「ラッセル日本株式マザーファンド」、「ラッセル外国株式マザーファンド」、「ラッセル日本債券マザーファンド」及び「ラッセル外国債券マザーファンド」の各受益証券を投資対象にしております。

なお、同各ファンド及び同各マザーファンドの現況は次のとおりであります。

純資産額計算書

ラッセル日本株式ファンド(適格機関投資家限定)

(2010年6月30日現在)

| 種類 | 金額 | 単位 |
|----------------|----------------|----|
| 資産総額 | 9,535,054,779 | 円 |
| 負債総額 | 5,737,904 | 円 |
| 純資産総額(-) | 9,529,316,875 | 円 |
| 発行済口数 | 11,631,556,497 | 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 0.8193 | 円 |

ラッセル外国株式ファンド(適格機関投資家限定)

(2010年6月30日現在)

| 種類 | 金額 | 単位 |
|----------------|---------------|----|
| 資産総額 | 3,675,101,387 | 円 |
| 負債総額 | 2,270,724 | 円 |
| 純資産総額(-) | 3,672,830,663 | 円 |
| 発行済口数 | 4,456,518,222 | 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 0.8241 | 円 |

ラッセル日本債券ファンド(適格機関投資家限定)

(2010年6月30日現在)

| 種類 | 金額 | 単位 |
|----------------|---------------|----|
| 資産総額 | 3,947,581,765 | 円 |
| 負債総額 | 26,120,655 | 円 |
| 純資産総額(-) | 3,921,461,110 | 円 |
| 発行済口数 | 3,450,471,865 | 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.1365 | 円 |

ラッセル外国債券ファンド Aコース(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)

(2010年6月30日現在)

| 種類 | 金額 | 単位 |
|----------------|---------------|----|
| 資産総額 | 3,380,932,742 | 円 |
| 負債総額 | 2,348,277 | 円 |
| 純資産総額(-) | 3,378,584,465 | 円 |
| 発行済口数 | 2,693,967,222 | 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.2541 | 円 |

ラッセル外国債券ファンド Bコース(為替ヘッジなし)(適格機関投資家限定)

(2010年6月30日現在)

| 種類 | 金額 | 単位 |
|----------------|-------------|----|
| 資産総額 | 691,557,350 | 円 |
| 負債総額 | 329,118 | 円 |
| 純資産総額(-) | 691,228,232 | 円 |
| 発行済口数 | 442,141,374 | 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.5634 | 円 |

(参考)ラッセル日本株式マザーファンド

(2010年6月30日現在)

| 種類 | 金額 | 単位 |
|----------------|----------------|----|
| 資産総額 | 50,666,879,296 | 円 |
| 負債総額 | 359,236,638 | 円 |
| 純資産総額(-) | 50,307,642,658 | 円 |
| 発行済口数 | 56,822,265,336 | 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 0.8854 | 円 |

(参考)ラッセル外国株式マザーファンド

(2010年6月30日現在)

| 種類 | 金額 | 単位 |
|----------------|----------------|----|
| 資産総額 | 37,937,814,320 | 円 |
| 負債総額 | 823,801,808 | 円 |
| 純資産総額(-) | 37,114,012,512 | 円 |
| 発行済口数 | 44,684,627,572 | 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 0.8306 | 円 |

(参考)ラッセル日本債券マザーファンド

(2010年6月30日現在)

| 種類 | 金額 | 単位 |
|----------------|----------------|----|
| 資産総額 | 15,365,367,886 | 円 |
| 負債総額 | 227,261,399 | 円 |
| 純資産総額(-) | 15,138,106,487 | 円 |
| 発行済口数 | 12,589,199,293 | 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.2025 | 円 |

(参考)ラッセル外国債券マザーファンド

(2010年6月30日現在)

| 種類 | 金額 | 単位 |
|----------------|----------------|----|
| 資産総額 | 14,657,257,419 | 円 |
| 負債総額 | 652,818,033 | 円 |
| 純資産総額(-) | 14,004,439,386 | 円 |
| 発行済口数 | 7,576,335,086 | 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.8484 | 円 |

第5【設定及び解約の実績】

<更新後>

「三菱UFJ MV20」

| | 設定口数 | 解約口数 | 発行済口数 |
|-------------------------------|----------------|---------------|----------------|
| 第1計算期間 | 28,050,180,244 | 1,987,491,981 | 26,062,688,263 |
| 第2計算期間 | 4,550,869,622 | 4,902,329,704 | 25,711,228,181 |
| 第3計算期間 | 703,431,522 | 4,045,367,398 | 22,369,292,305 |
| 第4計算期間 | 915,543,635 | 4,773,881,589 | 18,510,954,351 |
| 第5計算期間 | 1,517,973,758 | 9,266,072,694 | 10,762,855,415 |
| 第6計算期間 | 1,307,706,382 | 3,437,231,531 | 8,633,330,266 |
| 第7計算期間 | 908,702,074 | 2,092,689,330 | 7,449,343,010 |
| 第8計算期間 | 204,775,567 | 1,346,552,425 | 6,307,566,152 |
| 第9計算期間 | 145,432,780 | 786,124,164 | 5,666,874,768 |
| 第10計算期期首から 平成22年6月30日までの期間 | 83,494,611 | 624,367,963 | 5,126,001,416 |

(注) 第1計算期間の設定口数は、当初募集期間の当初設定口数を含みます。

「三菱UFJ MV40」

| | 設定口数 | 解約口数 | 発行済口数 |
|-------------------------------|---------------|---------------|----------------|
| 第1計算期間 | 9,647,153,043 | 313,702,391 | 9,333,450,652 |
| 第2計算期間 | 2,234,992,078 | 857,374,069 | 10,711,068,661 |
| 第3計算期間 | 670,182,702 | 1,451,626,244 | 9,929,625,119 |
| 第4計算期間 | 881,119,112 | 2,046,029,439 | 8,764,714,792 |
| 第5計算期間 | 1,773,820,029 | 2,854,191,756 | 7,684,343,065 |
| 第6計算期間 | 2,356,692,713 | 1,790,734,382 | 8,250,301,396 |
| 第7計算期間 | 707,130,384 | 1,817,349,448 | 7,140,082,332 |
| 第8計算期間 | 267,008,568 | 862,535,765 | 6,544,555,135 |
| 第9計算期間 | 250,976,215 | 669,525,279 | 6,126,006,071 |
| 第10計算期期首から 平成22年6月30日までの期間 | 124,587,433 | 728,884,912 | 5,521,708,592 |

(注) 第1計算期間の設定口数は、当初募集期間の当初設定口数を含みます。

「三菱UFJ MV80」

| | 設定口数 | 解約口数 | 発行済口数 |
|-------------------------------|---------------|---------------|---------------|
| 第1計算期間 | 4,417,604,374 | 232,241,006 | 4,185,363,368 |
| 第2計算期間 | 1,361,450,621 | 291,348,734 | 5,255,465,255 |
| 第3計算期間 | 884,671,359 | 618,556,653 | 5,521,579,961 |
| 第4計算期間 | 1,058,894,427 | 1,270,199,569 | 5,310,274,819 |
| 第5計算期間 | 986,306,292 | 1,855,337,441 | 4,441,243,670 |
| 第6計算期間 | 1,440,090,753 | 1,203,543,149 | 4,677,791,274 |
| 第7計算期間 | 954,789,968 | 1,306,741,996 | 4,325,839,246 |
| 第8計算期間 | 536,078,988 | 618,995,967 | 4,242,922,267 |
| 第9計算期間 | 394,092,784 | 444,957,723 | 4,192,057,328 |
| 第10計算期期首から 平成22年6月30日までの期間 | 189,208,390 | 223,665,840 | 4,157,599,878 |

(注) 第1計算期間の設定口数は、当初募集期間の当初設定口数を含みます。

第四部【特別情報】

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

<訂正前>

平成22年1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、124,098株を発行済です。

<訂正後>

平成22年6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、124,098株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

(2) 委託会社の機構

<訂正前>

(略)

ファンドの運用体制等は平成22年1月末現在のものであり、今後変更される可能性があります。

<訂正後>

(略)

ファンドの運用体制等は平成22年6月末現在のものであり、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。平成22年6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 | 330 | 5,635,240 |
| 追加型公社債投資信託 | 18 | 408,241 |
| 単位型株式投資信託 | 9 | 80,632 |
| 単位型公社債投資信託 | 7 | 114,021 |
| 合計 | 364 | 6,238,134 |

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

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

(1) 財務諸表の作成方法について

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

第24期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）は、改正前の財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき、第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）は、改正後の財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づいて作成しております。

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24期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）の財務諸表については、監査法人トーマツによる監査を受けており、第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）の財務諸表については、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。

なお、監査法人トーマツは、監査法人の種類の変更により、平成21年7月1日をもって有限責任監査法人トーマツとなりました。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

| | 第24期 (平成21年3月31日現在) | | 第25期 (平成22年3月31日現在) | |
|-------------------|------------------------|-------------------|------------------------|-------------------|
| (資産の部) | | | | |
| 流動資産 | | | | |
| 現金及び預金 | 2 | 8,398,952 | 2 | 8,675,536 |
| 有価証券 | 2 | 11,498,934 | 2 | 14,000,000 |
| 前払費用 | | 130,052 | | 136,193 |
| 未収入金 | | 133,300 | 2 | 45,397 |
| 未収委託者報酬 | | 3,496,056 | | 4,345,110 |
| 未収収益 | 2 | 77,468 | 2 | 43,835 |
| 繰延税金資産 | | 289,685 | | 407,456 |
| 金銭の信託 | 2 | 1,000,000 | 2 | 500,000 |
| その他 | | 13,229 | | 8,190 |
| 流動資産合計 | | 25,037,680 | | 28,161,721 |
| 固定資産 | | | | |
| 有形固定資産 | | | | |
| 建物 | 1 | 368,327 | 1 | 333,687 |
| 器具備品 | 1 | 168,906 | 1 | 158,971 |
| 土地 | | 1,205,031 | | 1,205,031 |
| 有形固定資産合計 | | 1,742,265 | | 1,697,691 |
| 無形固定資産 | | | | |
| 電話加入権 | | 15,822 | | 15,822 |
| ソフトウェア | | 809,683 | | 787,767 |
| ソフトウェア仮勘定 | | 7,316 | | 72,475 |
| その他 | | 156 | | 112 |
| 無形固定資産合計 | | 832,978 | | 876,178 |
| 投資その他の資産 | | | | |
| 投資有価証券 | | 11,906,934 | | 11,797,311 |
| 関係会社株式 | | 431,812 | | 431,812 |
| 長期性預金 | 2 | 2,000,000 | 2 | 5,000,000 |
| 長期差入保証金 | 2 | 844,978 | 2 | 1,030,783 |
| 長期前払費用 | | 4,371 | | 142 |
| 繰延税金資産 | | 473,766 | | 474,632 |
| その他 | | 20,485 | | 16,075 |
| 投資その他の資産合計 | | 15,682,348 | | 18,750,756 |
| 固定資産合計 | | 18,257,593 | | 21,324,626 |
| 資産合計 | | 43,295,274 | | 49,486,347 |

(単位：千円)

| | 第24期 (平成21年3月31日現在) | 第25期 (平成22年3月31日現在) |
|-------------------|------------------------|------------------------|
| (負債の部) | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 1,038,438 | 51,838 |
| 未払金 | | |
| 未払収益分配金 | 272,705 | 274,776 |
| 未払償還金 | 2,047,207 | 1,607,485 |
| 未払手数料 | 2 1,440,183 | 2 1,748,905 |
| その他未払金 | 110,716 | 52,889 |
| 未払費用 | 2 781,556 | 2 1,034,566 |
| 未払消費税等 | | 104,853 |
| 未払法人税等 | 595,981 | 1,727,215 |
| 仮受金 | 43 | |
| 賞与引当金 | 478,200 | 580,826 |
| デリバティブ債務 | | 7,536 |
| 流動負債合計 | 6,765,032 | 7,190,892 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | 13,304 | 68,206 |
| 役員退職慰労引当金 | 54,658 | 66,197 |
| 固定負債合計 | 67,962 | 134,404 |
| 負債合計 | 6,832,995 | 7,325,296 |
| (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 | 222,096 | 222,096 |
| 資本剰余金合計 | 222,096 | 222,096 |
| 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 | 27,520,492 | 31,383,254 |
| 利益剰余金合計 | 34,861,082 | 38,723,843 |
| 株主資本合計 | 37,083,309 | 40,946,071 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券 | 621,031 | 1,277,237 |
| 評価差額金 | | |
| 繰延ヘッジ損益 | | 62,258 |
| 評価・換算差額等合計 | 621,031 | 1,214,979 |
| 純資産合計 | 36,462,278 | 42,161,050 |
| 負債純資産合計 | 43,295,274 | 49,486,347 |

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

| | 第24期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日) | | 第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日) | |
|-------------|---------------------------------------|------------|---------------------------------------|------------|
| 営業収益 | | | | |
| 委託者報酬 | | 42,137,383 | | 40,630,847 |
| その他営業収益 | | | | |
| 投資顧問料 | | 7,887 | | 7,619 |
| その他 | | 8,381 | | 85,040 |
| 営業収益合計 | | 42,153,652 | | 40,723,506 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払手数料 | 2 | 18,452,482 | 2 | 17,208,659 |
| 広告宣伝費 | | 911,798 | | 579,833 |
| 公告費 | | 4,088 | | 7,195 |
| 調査費 | | | | |
| 調査費 | | 778,991 | | 799,697 |
| 委託調査費 | | 4,427,117 | | 5,231,920 |
| 事務委託費 | | 229,877 | | 183,931 |
| 営業雑経費 | | | | |
| 通信費 | | 114,009 | | 98,055 |
| 印刷費 | | 640,249 | | 607,867 |
| 協会費 | | 42,295 | | 35,983 |
| 諸会費 | | 6,356 | | 5,761 |
| 事務機器関連費 | | 820,190 | | 841,349 |
| 営業費用合計 | | 26,427,456 | | 25,600,255 |
| 一般管理費 | | | | |
| 給料 | | | | |
| 役員報酬 | | 171,783 | | 194,520 |
| 給料・手当 | | 3,243,471 | | 3,445,656 |
| 賞与引当金繰入 | | 478,200 | | 580,826 |
| 福利厚生費 | | 427,372 | | 458,092 |
| 交際費 | | 20,785 | | 21,080 |
| 旅費交通費 | | 126,644 | | 108,299 |
| 租税公課 | | 112,608 | | 102,967 |
| 不動産賃借料 | | 658,309 | | 654,768 |
| 退職給付費用 | | 151,382 | | 177,435 |
| 役員退職慰労引当金繰入 | | 17,566 | | 18,448 |
| 固定資産減価償却費 | | 345,975 | | 382,798 |
| 諸雑費 | | 368,982 | | 287,163 |
| 一般管理費合計 | | 6,123,082 | | 6,432,057 |
| 営業利益 | | 9,603,113 | | 8,691,194 |

(単位：千円)

| | 第24期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日) | | 第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日) | |
|----------------|---------------------------------------|-----------|---------------------------------------|-----------|
| 営業外収益 | | | | |
| 受取配当金 | | 185,609 | | 30,250 |
| 有価証券利息 | 2 | 55,030 | 2 | 29,170 |
| 受取利息 | 2 | 21,926 | 2 | 19,853 |
| 投資有価証券償還益 | | | | 73,517 |
| 収益分配金等時効完成分 | | 111,003 | | 421,674 |
| その他 | | 5,225 | | 8,586 |
| 営業外収益合計 | | 378,796 | | 583,053 |
| 営業外費用 | | | | |
| 投資有価証券償還損 | | | | 181,632 |
| 収益分配金等時効完成分支払額 | | 62,259 | | 10,520 |
| 事務過誤費 | | 13,871 | | 7,510 |
| その他 | | 7,266 | | 3,626 |
| 営業外費用合計 | | 83,398 | | 203,289 |
| 経常利益 | | 9,898,511 | | 9,070,957 |
| 特別利益 | | | | |
| 投資有価証券売却益 | | 15,399 | | 231,903 |
| ゴルフ会員権売却益 | | | | 10,190 |
| 特別利益合計 | | 15,399 | | 242,093 |
| 特別損失 | | | | |
| 投資有価証券売却損 | | 228,868 | | 129,159 |
| 投資有価証券評価損 | | 2,124,730 | | |
| 固定資産除却損 | 1 | 2,488 | 1 | 701 |
| その他 | | 5,965 | | |
| 特別損失合計 | | 2,362,053 | | 129,860 |
| 税引前当期純利益 | | 7,551,856 | | 9,183,190 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 3,801,688 | | 3,627,233 |
| 法人税等調整額 | | 144,759 | | 118,635 |
| 法人税等合計 | | 3,946,448 | | 3,508,597 |
| 当期純利益 | | 3,605,408 | | 5,674,592 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

| | 第24期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日) | 第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日) |
|---------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 株主資本 | | |
| 資本金 | | |
| 前期末残高 | 2,000,131 | 2,000,131 |
| 当期変動額 | | |
| 当期変動額合計 | | |
| 当期末残高 | 2,000,131 | 2,000,131 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | | |
| 前期末残高 | 222,096 | 222,096 |
| 当期変動額 | | |
| 当期変動額合計 | | |
| 当期末残高 | 222,096 | 222,096 |
| 資本剰余金合計 | | |
| 前期末残高 | 222,096 | 222,096 |
| 当期変動額 | | |
| 当期変動額合計 | | |
| 当期末残高 | 222,096 | 222,096 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | | |
| 前期末残高 | 342,589 | 342,589 |
| 当期変動額 | | |
| 当期変動額合計 | | |
| 当期末残高 | 342,589 | 342,589 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | | |
| 前期末残高 | 6,998,000 | 6,998,000 |
| 当期変動額 | | |
| 当期変動額合計 | | |
| 当期末残高 | 6,998,000 | 6,998,000 |
| 繰越利益剰余金 | | |
| 前期末残高 | 28,643,217 | 27,520,492 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 4,728,133 | 1,811,830 |
| 当期純利益 | 3,605,408 | 5,674,592 |
| 当期変動額合計 | 1,122,725 | 3,862,761 |
| 当期末残高 | 27,520,492 | 31,383,254 |
| 利益剰余金合計 | | |
| 前期残高 | 35,983,807 | 34,861,082 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 4,728,133 | 1,811,830 |
| 当期純利益 | 3,605,408 | 5,674,592 |
| 当期変動額合計 | 1,122,725 | 3,862,761 |
| 当期末残高 | 34,861,082 | 38,723,843 |
| 株主資本合計 | | |
| 前期末残高 | 38,206,035 | 37,083,309 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 4,728,133 | 1,811,830 |
| 当期純利益 | 3,605,408 | 5,674,592 |
| 当期変動額合計 | 1,122,725 | 3,862,761 |
| 当期末残高 | 37,083,309 | 40,946,071 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | | |
| 前期末残高 | 119,404 | 621,031 |
| 当期変動額 | | |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | 501,627 | 1,898,269 |
| 当期変動額合計 | 501,627 | 1,898,269 |
| 当期末残高 | 621,031 | 1,277,237 |
| 繰延ヘッジ損益 | | |
| 前期末残高 | | |
| 当期変動額 | | |

| | | |
|---------------------|------------|------------|
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | | 62,258 |
| 当期変動額合計 | | 62,258 |
| 当期末残高 | | 62,258 |
| 評価・換算差額等合計 | | |
| 前期末残高 | 119,404 | 621,031 |
| 当期変動額 | | |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | 501,627 | 1,836,011 |
| 当期変動額合計 | 501,627 | 1,836,011 |
| 当期末残高 | 621,031 | 1,214,979 |
| 純資産合計 | | |
| 前期末残高 | 38,086,630 | 36,462,278 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 4,728,133 | 1,811,830 |
| 当期純利益 | 3,605,408 | 5,674,592 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | 501,627 | 1,836,011 |
| 当期変動額合計 | 1,624,352 | 5,698,772 |
| 当期末残高 | 36,462,278 | 42,161,050 |

重要な会計方針

| 項目 | 第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日) | 第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日) |
|---------------------------|--|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 子会社株式：移動平均法による原価法によっております。 その他有価証券： 時価のあるものは決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)によっております。 時価のないものは移動平均法による原価法によっております。 | 同 左 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | - | 時価法によっております。 |
| 3. 固定資産の減価償却の方法 | | |
| (1) 有形固定資産 | 定率法を採用しております。 なお、主な耐用年数は、建物38年であります。 | 同 左 |
| (2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェア | 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。 | 同 左 |
| それ以外の無形固定資産 | 定額法を採用しております。 | 同 左 |
| 4. 外貨建の資産又は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。 | 同 左 |
| 5. 引当金の計上基準 | | |
| (1) 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。 | 同 左 |
| (2) 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。 数理計算上の差異は、その発生年度の従業員の平均支払期間以内の一定の年数(8年)による定額法により、翌事業年度より費用処理することとしております。 | 同 左 |
| (3) 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。 | 同 左 |
| 6. ヘッジ会計の手法 | | |
| (1) ヘッジ会計の方法 | - | 繰延ヘッジ処理によっております。 |
| (2) ヘッジ手段とヘッジ対象 | - | 当事業年度にヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。 a. ヘッジ手段... 株価指数先物 ヘッジ対象... 投資有価証券 b. ヘッジ手段... 株式関連オプション ヘッジ対象... 投資有価証券 |
| (3) ヘッジ方針 | - | 当社の内規である「ヘッジ取引に関する内規」に基づき、ヘッジ対象に係る価格変動リスクを一定の範囲内でヘッジしております。 |

| | | |
|-----------------|---------------|--|
| (4) ヘッジ有効性評価の方法 | - | ヘッジ対象の騰落率とヘッジ手段の騰落率を比較し、両者の変動額を基礎にして、有効性を評価しております。 |
| 7.消費税等の会計処理 | 税抜方式によっております。 | 同 左 |

重要な会計方針の変更

| 第24期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日) | 第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日) |
|---------------------------------------|---|
| - | 当事業年度より、「退職給付に係る会計基準」の一部改正(その3) (企業会計基準第19号 平成20年7月31日)を適用しております。なお、これによる営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響はありません。 |

注記事項

(貸借対照表関係)

| 項目 | 第24期 (平成21年3月31日現在) | 第25期 (平成22年3月31日現在) |
|-------------------|---|--|
| 1.有形固定資産の減価償却累計額 | 建物 117,264千円 器具備品 130,206千円 | 建物 152,240千円 器具備品 167,633千円 |
| 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。 預金 5,493,354千円 有価証券 11,000,000千円 未収収益 5,233千円 金銭の信託 1,000,000千円 長期性預金 2,000,000千円 長期差入保証金 837,940千円 未払手数料 868,907千円 未払費用 198,857千円 | 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。 預金 5,272,377千円 有価証券 14,000,000千円 未収入金 2,072千円 未収収益 43,545千円 金銭の信託 500,000千円 長期性預金 5,000,000千円 長期差入保証金 837,940千円 未払手数料 1,005,639千円 未払費用 153,908千円 |

（損益計算書関係）

| 項目 | 第24期 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日） | | 第25期 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日） | |
|---------------------|--|-----------------|--|---------------|
| | 1. 固定資産除却損の内 訳 | 器具備品 1,961千円 | ソフトウェア 527千円 | 器具備品 701千円 |
| 2. 関係会社に対する 主な取引 | 区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。 支払手数料 12,493,304千円 有価証券利息 44,704千円 受取利息 21,926千円 | | 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。 支払手数料 11,148,518千円 有価証券利息 26,197千円 受取利息 19,853千円 | |

（株主資本等変動計算書関係）

第24期（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

| | 前事業年度末 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 | 124,098 | - | - | 124,098 |
| 合計 | 124,098 | - | - | 124,098 |

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成20年6月30日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

| | |
|----------|-------------|
| 配当金の総額 | 4,728,133千円 |
| 1株当たり配当額 | 38,100円 |
| 基準日 | 平成20年3月31日 |
| 効力発生日 | 平成20年7月1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

平成21年6月29日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

| | |
|----------|-------------|
| 配当金の総額 | 1,811,830千円 |
| 配当の原資 | 利益剰余金 |
| 1株当たり配当額 | 14,600円 |
| 基準日 | 平成21年3月31日 |
| 効力発生日 | 平成21年6月30日 |

第25期（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

| | 前事業年度末 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 | 124,098 | - | - | 124,098 |
| 合計 | 124,098 | - | - | 124,098 |

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成21年6月29日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

| | |
|----------|-------------|
| 配当金の総額 | 1,811,830千円 |
| 1株当たり配当額 | 14,600円 |
| 基準日 | 平成21年3月31日 |
| 効力発生日 | 平成21年6月30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
平成22年6月30日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

| | |
|----------|-------------|
| 配当金の総額 | 2,841,844千円 |
| 配当の原資 | 利益剰余金 |
| 1株当たり配当額 | 22,900円 |
| 基準日 | 平成22年3月31日 |
| 効力発生日 | 平成22年7月1日 |

(金融商品関係)

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

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、譲渡性預金または投資信託に限定しており、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。このうち一部の投資信託については価格変動リスクを回避するために、デリバティブ取引を行っております。

デリバティブ取引は、投資信託に係る価格変動リスクに対するヘッジを目的とした先物取引及びオプション取引であります。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「6.ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

デリバティブ取引の利用にあたっては、カウンターパーティーリスクを軽減するために、格付の高い金融機関とのみ取引を行っております。

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

投資信託については、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。

デリバティブ取引については、内部管理規程に従い、実需の範囲で行うこととしております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。また、注記事項「デリバティブ取引関係」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日(当期の決算日)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません(注2)参照)。

(単位:千円)

| | 貸借対照表 計上額(*1) | 時価(*1) | 差額 |
|------------------|------------------|-------------|-------|
| (1) 現金及び預金 | 8,675,536 | 8,675,536 | - |
| (2) 有価証券 | 14,000,000 | 14,000,000 | - |
| (3) 未収委託者報酬 | 4,345,110 | 4,345,110 | - |
| (4) 長期性預金 | 5,000,000 | 5,007,477 | 7,477 |
| (5) 投資有価証券 | 11,533,054 | 11,533,054 | - |
| (6) 未払手数料 | (1,748,905) | (1,748,905) | - |
| (7) 未払法人税等 | (1,727,215) | (1,727,215) | - |
| (8) デリバティブ取引(*2) | (7,536) | (7,536) | - |

(*1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 有価証券並びに(3) 未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。なお、有価証券はすべて短期決済される譲渡性預金であります。

(4) 長期性預金

契約期間に基づく区分ごとに、新規に預金を行った場合に想定される預金金利で割り引いた現在価値を算定しております。

(5) 投資有価証券

上記の表中における投資有価証券はすべて投資信託であり、公表されている基準価額によっております。

(6) 未払手数料、並びに(7) 未払法人税等

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

(8) デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式(貸借対照表計上額264,257千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式431,812千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(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 | 8,675,536 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 4,345,110 | - | - | - |
| 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 | | | | |
| 譲渡性預金 | 14,000,000 | - | - | - |
| 投資信託 | - | 3,044,412 | 62,645 | - |
| 長期性預金 | - | 5,000,000 | - | - |
| 合計 | 27,020,647 | 8,044,412 | 62,645 | - |

(追加情報)

当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日)を適用しております。

(有価証券関係)

第24期（平成21年3月31日現在）

1. その他有価証券で時価のあるもの

| | 種類 | 取得原価 (千円) | 貸借対照表計上額 (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 | 1,465,168 | 1,522,867 | 57,698 |
| | 小計 | 1,465,168 | 1,522,867 | 57,698 |
| 貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの | 株式 | - | - | - |
| | 債券 | - | - | - |
| | その他 | 8,557,951 | 7,573,200 | 984,750 |
| | 小計 | 8,557,951 | 7,573,200 | 984,750 |
| 合計 | | 10,023,119 | 9,096,067 | 927,052 |

(注) 当事業年度において、有価証券について2,124,730千円（その他有価証券で時価のある証券投資信託2,124,730千円）減損処理を行っております。なお、証券投資信託の減損処理は、期末における時価が簿価に比べ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。

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）

| 売却額(千円) | 売却益の合計額(千円) | 売却損の合計額(千円) |
|-----------|-------------|-------------|
| 1,729,081 | 15,399 | 228,868 |

3. 時価評価されていない主な有価証券の内容

| | 貸借対照表計上額 |
|---------------|--------------|
| その他有価証券 | |
| MMF | 2,014,549千円 |
| キャッシュファンド | 1,008,475千円 |
| 譲渡性預金 | 11,000,000千円 |
| 非上場株式 | 286,777千円 |
| 子会社株式及び関連会社株式 | |
| 子会社株式 | 431,812千円 |

4. その他有価証券のうち満期があるものの今後の償還予定

| | 1年以内 (千円) | 1年超5年以内 (千円) | 5年超10年以内 (千円) | 10年超 (千円) |
|------|--------------|-----------------|------------------|--------------|
| 投資信託 | 498,934 | 2,262,320 | 482,062 | - |
| 合計 | 498,934 | 2,262,320 | 482,062 | - |

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式431,812千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

2. その他有価証券

| | 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 | 6,083,784 | 4,825,309 | 1,258,474 |
| | 小計 | 6,083,784 | 4,825,309 | 1,258,474 |
| 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 | 5,449,270 | 5,692,652 | 243,382 |
| | 小計 | 5,449,270 | 5,692,652 | 243,382 |
| 合計 | | 11,533,054 | 10,517,961 | 1,015,092 |

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額264,257千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券（自平成21年4月1日至平成22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 | 11,600 | - | 10,920 |
| 債券 | - | - | - |
| その他 | 1,988,176 | 253,043 | 118,239 |
| 合計 | 1,999,776 | 253,043 | 129,159 |

（デリバティブ取引関係）

第24期（自平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

第25期（自平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当するものではありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

株式関連

（単位：千円）

| ヘッジ会計の手法 | 取引の種類 | 主なヘッジ対象 | 当事業年度（平成22年3月31日） | | |
|----------|----------|---------|-------------------|------------|-------|
| | | | 契約額等 | 契約額等のうち1年超 | 時価 |
| 原則的処理方法 | 先物取引（売建） | 投資有価証券 | 373,043 | - | 7,536 |

（注）時価の算定方法 取引所の価格及び決算日の為替レートによっております。

（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、従業員に対して適格退職年金制度及び退職一時金制度を設けております。なお、平成18年6月に適格退職年金制度及び退職一時金制度の一部について確定拠出年金制度へ移行しました。

2. 退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

| | 第24期 (平成21年3月31日現在) | 第25期 (平成22年3月31日現在) |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| (1)退職給付債務 | 771,109 | 661,846 |
| (2)年金資産 | 454,977 | 416,582 |
| (3)未積立退職給付債務 (1)+(2) | 316,132 | 245,263 |
| (4)未認識数理計算上の差異 | 306,966 | 177,056 |
| (5)貸借対照表計上額純額 (3)+(4) | 9,164 | 68,206 |
| (6)前払年金費用 | 4,139 | — |
| (7)退職給付引当金 (5) - (6) | 13,304 | 68,206 |

3. 退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

| | 第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日) | 第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日) |
|-------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| (1)勤務費用 | 29,439 | 28,685 |
| (2)利息費用 | 12,676 | 11,367 |
| (3)期待運用収益 | 10,905 | 6,824 |
| (4)数理計算上の差異の費用処理額 | 38,186 | 57,581 |
| (5)退職給付費用 | 69,396 | 90,809 |
| (6)その他 | 81,986 | 86,626 |
| (7)合計 | 151,382 | 177,435 |

（注）「(6)その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

4. 退職給付の計算基礎に関する事項

| | 第24期 (平成21年3月31日現在) | 第25期 (平成22年3月31日現在) |
|--------------------|---|------------------------|
| (1) 割引率 | 1.5% | 同左 |
| (2) 期待運用収益率 | 1.5% | 同左 |
| (3) 退職給付見込額の期間配分方法 | 期間定額基準 | 同左 |
| (4) 数理計算上の差異の処理年数 | 各事業年度の発生時における従業員の平均支払期間以内の一定の年数（8年）による定額法により、翌事業年度より費用処理しております。 | |

(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

(単位：千円)

| | 第24期 (平成21年3月31日現在) | 第25期 (平成22年3月31日現在) |
|---------------|------------------------|------------------------|
| 繰延税金資産 | | |
| 減損損失 | 689,220 | 669,724 |
| 投資有価証券評価損 | 1,041,250 | 849,883 |
| ゴルフ会員権評価損 | 30,885 | 9,710 |
| 未払事業税 | 49,084 | 136,281 |
| 賞与引当金 | 194,579 | 236,338 |
| 役員退職慰労引当金 | 22,240 | 26,935 |
| 退職給付引当金 | 5,413 | 27,753 |
| 退職一時金未払 | 14,992 | - |
| 減価償却超過額 | 63,725 | 54,520 |
| 委託者報酬 | 124,519 | 106,666 |
| その他有価証券評価差額金 | 377,217 | - |
| その他 | 32,298 | 62,287 |
| 繰延税金資産 小計 | 2,645,429 | 2,180,101 |
| 評価性引当額 | 1,880,292 | 1,298,012 |
| 繰延税金資産 合計 | 765,137 | 882,088 |
| 繰延税金負債 | | |
| 前払年金費用 | 1,684 | - |
| 繰延税金負債 合計 | 1,684 | - |
| 繰延税金資産(負債)の純額 | 763,452 | 882,088 |

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原因

| | 第24期 (平成21年3月31日現在) | 第25期 (平成22年3月31日現在) |
|-------------------|------------------------|---------------------------|
| 法定実効税率 | (%) 40.7 | 法定実効税率 (%) 40.7 |
| (調整) | | (調整) |
| 投資有価証券評価損に係る損金不算入 | 11.4 | 投資有価証券評価損認容 2.1 |
| その他 | 0.2 | その他 0.4 |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 52.3 | 税効果会計適用後の法人税等の負担率 38.2 |

（関連当事者情報）

第24期（自平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

（追加情報）

当事業年度より、「関連当事者の開示に関する会計基準」（企業会計基準第11号 平成18年10月17日）及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第13号 平成18年10月17日）を適用しております。

この結果、従来の開示対象に加えて、親会社に関する注記が開示対象に追加されております。

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

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の被所有割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 | |
|------|--------------|---------|------------------|-------------|-------------|-------------------------------|-------------------|-------------------|------------------|---------------|------------------|
| 主要株主 | 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 | 直接 30.0% | 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 | 4,440,945 千円 | 未払手数料 | 239,286 千円 | |
| | | | | | | | 事務所の賃借 | 631,409 千円 | 長期差入保証金 | 833,144 千円 | |
| | | | | | | | 投資の助言 | 264,141 千円 | 未払費用 | 146,190 千円 | |
| 主要株主 | (株)三菱東京UFJ銀行 | 東京都千代田区 | 1,196,295 百万円 | 銀行業 | 直接 15.0% | 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 | 8,052,358 千円 | 未払手数料 | 629,621 千円 | |
| | | | | | | | 取引銀行 | 譲渡性預金の預入 | 34,000,000 千円 | 有価証券 | 11,000,000 千円 |
| | | | | | | | | 譲渡性預金に係る受取利息 | 44,704 千円 | 未収利息 | 3,900 千円 |
| | | | | | | | | マルチコーラブル預金の預入 | 3,000,000 千円 | 長期性預金 | 2,000,000 千円 |
| | | | | | | | | マルチコーラブル預金に係る受取利息 | 4,423 千円 | 未収利息 | 35 千円 |

取引条件及び取引条件の決定方針等

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。

事務所敷金及び賃借料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。

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

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の被所有割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 |
|-------------|------------|---------|-----------|-------|------------|-------------------------------|-------------------|-------------|-------|-----------|
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJ証券(株) | 東京都千代田区 | 65,518百万円 | 証券業 | - | 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 | 2,400,621千円 | 未払手数料 | 296,719千円 |

取引条件及び取引条件の決定方針等

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。

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、大阪証券取引所、名古屋証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

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

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の被所有割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 | |
|------|--------------|-------------------|--------------|---------|------------|-------------------------------|-------------------|---------------|--------------|-----------|--------------|
| 主要株主 | 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30.0% | 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 | 4,064,069千円 | 未払手数料 | 285,840千円 | |
| | | | | | | | 事務所の賃借料 | 631,409千円 | 長期差入保証金 | 833,144千円 | |
| | | | | | | | 投資の助言 | 186,556千円 | 未払費用 | 99,917千円 | |
| 主要株主 | (株)三菱東京UFJ銀行 | 東京都千代田区 | 1,711,958百万円 | 銀行業 | 被所有直接15.0% | 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 | 7,084,449千円 | 未払手数料 | 719,799千円 | |
| | | | | | | | 取引銀行 | 譲渡性預金の預入 | 49,000,000千円 | 有価証券 | 14,000,000千円 |
| | | | | | | | | 譲渡性預金に係る受取利息 | 26,197千円 | 未収利息 | 1,234千円 |
| | | | | | | | | マルチコーラブル預金の預入 | 5,000,000千円 | 長期性預金 | 5,000,000千円 |
| | | マルチコーラブル預金に係る受取利息 | 16,869千円 | 未収利息 | 1,597千円 | | | | | | |

取引条件及び取引条件の決定方針等

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。

事務所敷金及び賃借料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は3ヶ月～3年であります。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

| 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 | 科目 | 期末残高 |
|-------------|------------|---------|-----------|-------|----------------|-------------------------------|-------------------|-------------|-------|-----------|
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJ証券(株) | 東京都千代田区 | 65,518百万円 | 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 | 2,822,731千円 | 未払手数料 | 397,272千円 |

取引条件及び取引条件の決定方針等

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。

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、大阪証券取引所、名古屋証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

| 項目 | 第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日) | 第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日) |
|------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 1株当たり純資産額 | 293,818円41銭 | 339,739円97銭 |
| 1株当たり当期純利益 | 29,052円91銭 | 45,726円70銭 |

(注)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。

1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

| 項目 | 第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日) | 第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日) |
|------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 当期純利益(千円) | 3,605,408 | 5,674,592 |
| 普通株式に帰属しない金額(千円) | - | - |
| 普通株式に係る当期純利益(千円) | 3,605,408 | 5,674,592 |
| 期中平均株式数(株) | 124,098 | 124,098 |

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**

< 訂正前 >

(略)

資本金の額：324,279百万円（平成21年9月末現在）

(略)

< 訂正後 >

(略)

資本金の額：324,279百万円（平成22年3月末現在）

(略)

(2) 販売会社

< 更新後 >

| 名称 | 資本金の額 (平成22年3月末現在) | 事業の内容 |
|-----------------------|----------------------------|-------------------------------|
| 株式会社三菱東京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。 |
| 三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社 | 3,000 百万円 (平成22年5月1日現在) | 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【資本関係】

< 訂正前 >

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（平成22年1月末現在）

(略)

< 訂正後 >

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（平成22年6月末現在）

(略)

独立監査人の中間監査報告書

平成22年7月27日

三菱UFJ投信株式会社
取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 荒川 進 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 鶴田光夫 印
業務執行社員

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 MV20の平成21年12月15日から平成22年6月14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。この中間財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は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を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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 MV20の平成22年6月14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（平成21年12月15日から平成22年6月14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。

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

以上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成22年7月27日

三菱UFJ投信株式会社
取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 荒川 進 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 鶴田光夫 印
業務執行社員

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 MV40の平成21年12月15日から平成22年6月14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。この中間財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は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を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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 MV40の平成22年6月14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（平成21年12月15日から平成22年6月14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。

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

以上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成22年7月27日

三菱UFJ投信株式会社
取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 荒川 進 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 鶴田光夫 印
業務執行社員

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 MV80の平成21年12月15日から平成22年6月14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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は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を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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 MV80の平成22年6月14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（平成21年12月15日から平成22年6月14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。

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

以上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[前へ](#) [次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月30日

三菱UFJ投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

| | | |
|--------------------|-------|-----------|
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 村山 周平 印 |
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 後藤 徳彌 印 |
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 五十幡 理一郎 印 |

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投信株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第25期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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。

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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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投信株式会社の平成22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すべ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。

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

以上

(注) 上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。

[前へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成21年7月22日

三菱UFJ投信株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員
業務執行社員

公認会計士 荒川 進 印

指定社員
業務執行社員

公認会計士 鶴田光夫 印

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 MV20の平成20年12月13日から平成21年6月12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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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 MV20の平成21年6月12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（平成20年12月13日から平成21年6月12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。

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

以上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成21年7月22日

三菱UFJ投信株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員
業務執行社員

公認会計士 荒川 進 印

指定社員
業務執行社員

公認会計士 鶴田光夫 印

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 MV40の平成20年12月13日から平成21年6月12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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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 MV40の平成21年6月12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（平成20年12月13日から平成21年6月12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。

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

以上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成21年7月22日

三菱UFJ投信株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

| | |
|----------------|--------------|
| 指定社員 業務執行社員 | 公認会計士 荒川 進 印 |
|----------------|--------------|

| | |
|----------------|--------------|
| 指定社員 業務執行社員 | 公認会計士 鶴田光夫 印 |
|----------------|--------------|

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 MV80の平成20年12月13日から平成21年6月12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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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 MV80の平成21年6月12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（平成20年12月13日から平成21年6月12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。

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

以上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[前へ](#) [次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年6月30日

三菱UFJ投信株式会社

取締役会 御中

監査法人 トーマツ

| | | |
|----------------|-------|-----------|
| 指定社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 桃崎 有治 印 |
| 指定社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 村山 周平 印 |
| 指定社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 五十幡 理一郎 印 |

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投信株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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。

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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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投信株式会社の平成21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すべ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。

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

以上

(注) 上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。

[前へ](#)