

【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23年 9 月12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】 井上 靖
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 三菱ＵＦＪ ＭＶ２０
受益証券に係るファンドの名称】 三菱ＵＦＪ ＭＶ４０
三菱ＵＦＪ ＭＶ８０
(以上を総称して「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 継続募集額 各ファンドにつき、上限 1 兆円
受益証券の金額】
【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23年3月11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>の記載事項は原届出書の更新後の内容を示します。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】****[ファンドの目的・特色]****ファンドの特色****<更新後>**

（略）

<分配方針>

（略）

・分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

（略）

<ラッセルの運用体制>

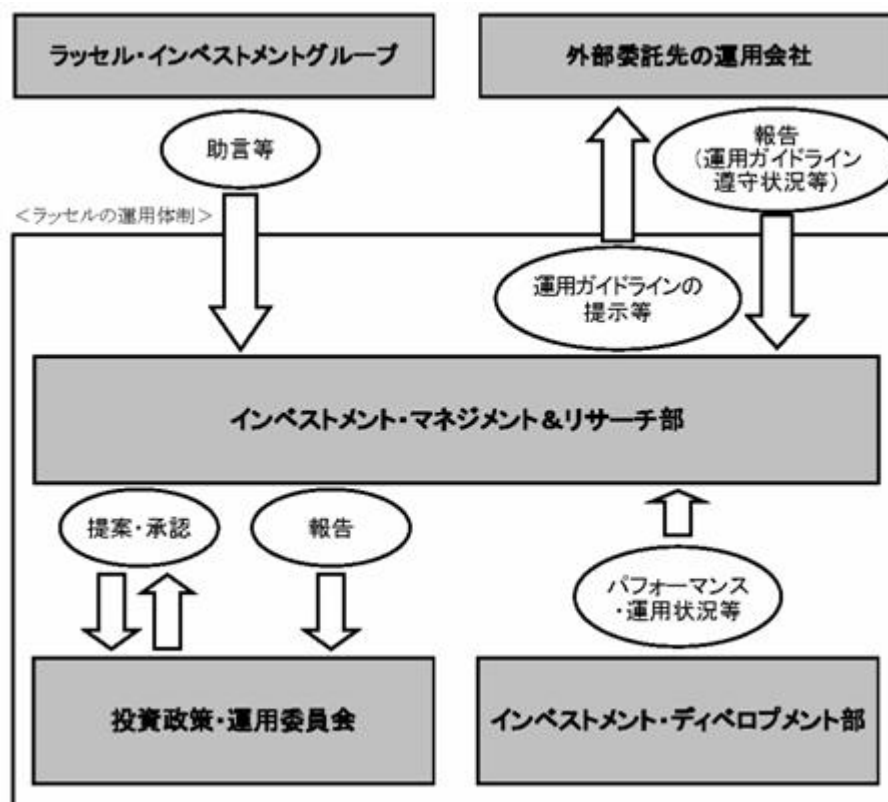
（略）

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関しては、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。

インベストメント・ディベロプメント部は、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）

（略）



上記体制は、今後変更される場合があります。

(3) 【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12月末現在）
（略）
- ・大株主の状況（平成22年12月末現在）

株 主 名	住 所	所有株式数	所有比率
株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	東京都千代田区丸の内二丁目 7 番 1 号	68,253株	55.0%
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目 4 番 5 号	37,230株	30.0%
株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行	東京都千代田区丸の内二丁目 7 番 1 号	18,615株	15.0%

< 訂正後 >

- ・資本金
2,000百万円（平成23年 6 月末現在）
（略）
- ・大株主の状況（平成23年 6 月末現在）

株 主 名	住 所	所有株式数	所有比率
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目 4 番 5 号	62,050株	50.0%
株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	東京都千代田区丸の内二丁目 7 番 1 号	31,025株	25.0%
株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行	東京都千代田区丸の内二丁目 7 番 1 号	31,023株	25.0%

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）

（運用方法）

（略）

投資態度

(略)

- d．実質外貨建資産に対する為替ヘッジは、市況動向、資金動向等により委託会社が適切と判断した場合に行うことがあります。

(略)

投資制限

(略)

- b．ラッセル 日本株式マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

(略)

(ファンドに係る費用)

(略)

その他の費用

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および借入金の利息は、受益者の負担として信託財産から支払われます。

(略)

ラッセル 外国株式ファンド II（適格機関投資家限定）

(略)

(運用方法)

(略)

投資態度

(略)

- c．実質外貨建資産に対する為替ヘッジは、市況動向、資金動向等により委託会社が適切と判断した場合に行うことがあります。

(略)

投資制限

(略)

- b．ラッセル 外国株式マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

(略)

(ファンドに係る費用)

(略)

その他の費用

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および借入金の利息は、受益者の負担として信託財産から支払われます。

(略)

ラッセル 日本債券ファンド II（適格機関投資家限定）

(略)

(運用方法)

(略)

投資制限

(略)

- c．ラッセル 日本債券マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

(略)

(ファンドに係る費用)

(略)

その他の費用

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および借入金の利息は、受益者の負担として信託財産から支払われます。

(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）

投資制限

（略）

- c. ラッセル 外国債券マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

（略）

（ファンドに係る費用）

（略）

その他の費用

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および借入金の利息は、受益者の負担として信託財産から支払われます。

（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

（略）

運用権限の委託先（平成23年7月29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	住友信託銀行株式会社（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）
	ラッセル・インプリメンテーション・サービシーズ・インク（米国） 後記（注）をご覧ください
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）をご覧ください	ラッセル・インプリメンテーション・サービシーズ・インク（米国）

2 ラッセル 外国株式マザーファンド受益証券

（略）

運用権限の委託先（平成23年7月29日現在）

（略）

3 ラッセル 日本債券マザーファンド受益証券

（略）

運用権限の委託先（平成23年7月29日現在）

（略）

4 ラッセル 外国債券マザーファンド受益証券

（略）

運用権限の委託先（平成23年7月29日現在）

（略）

（3）【運用体制】

<訂正前>

（略）

ファンドの運用体制等は平成23年3月12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23年9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。

3【投資リスク】

（１）投資リスク

<更新後>

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

（略）

留意事項

<訂正前>

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。

<訂正後>

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。

- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。

投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。

収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。

（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〕

<訂正前>

（略）

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 T o k y o 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カイ離の上限、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。

<訂正後>

（略）

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 T o k y o 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。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カイ離の上限、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。グループ会社が外部委託先運用会社に含まれる場合、当該グループ会社に対しても必要な監督を行っています。

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・信託約款等の遵守状況です。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。

4【手数料等及び税金】

(3)【信託報酬等】

「三菱ＵＦＪ ＭＶ４０」

<更新後>

(略)

受益者が負担する実質的な信託報酬率（概算値）は、次の通りとなります。

実質的な信託報酬率（概算値）	うち投資信託証券に係る率
年1.6905%（税込）程度	年0.882%（税込）程度

(略)

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

個人の受益者に対する課税

(略)

平成23年12月31日まで適用される税率です。平成24年以降は、20%（所得税15%および地方税5%）の税率となる予定です。

法人の受益者に対する課税

(略)

平成23年12月31日まで適用される税率です。平成24年以降は、15%（所得税15%）の税率となる予定です。

(略)

収益分配金について

(略)

税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

課税上の取扱いの詳細については、税務署等にご確認ください。

<訂正後>

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

(略)

平成25年12月31日まで適用される税率です。平成26年1月1日以降は、20%（所得税15%および地方税5%）の税率となる予定です。

法人の受益者に対する課税

(略)

平成25年12月31日まで適用される税率です。平成26年1月1日以降は、15%（所得税15%）の税率となる予定です。

(略)

収益分配金について

(略)

上記は平成23年6月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

<更新後>

「三菱UFJ MV20」

(1)【投資状況】

平成23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	4,355,821,116	99.04
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		42,290,131	0.96
純資産総額		4,398,111,247	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23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		1,493,657,819	1.1292 1.1442	1,686,666,788 1,709,043,276		38.86
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		1,215,075,871	1.2388 1.2534	1,505,339,270 1,522,976,096		34.63
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		807,052,295	0.8572 0.8368	691,842,351 675,341,360		15.36
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		228,435,347	0.9680 0.9938	221,141,022 227,019,047		5.16
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		140,490,634	1.5385 1.5762	216,144,840 221,441,337		5.03

(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23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23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) 25,615,422,469 (分配落)	9,828 (分配付) 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) 25,053,285,644 (分配落)	9,744 (分配付) 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) 22,380,772,012 (分配落)	10,091 (分配付) 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) 18,749,155,611 (分配落)	10,479 (分配付) 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) 11,416,361,985 (分配落)	10,907 (分配付) 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）
第10計算期間末日 （平成22年12月13日）	4,891,633,236（分配付） 4,843,800,835（分配落）	10,227（分配付） 10,127（分配落）
平成22年 6月末日	5,216,118,411	10,176
7月末日	5,180,779,908	10,243
8月末日	5,072,550,879	10,250
9月末日	5,048,286,843	10,347
10月末日	4,937,246,612	10,219
11月末日	4,896,526,115	10,230
12月末日	4,827,379,418	10,168
平成23年 1月末日	4,719,564,705	10,191
2月末日	4,686,732,631	10,235
3月末日	4,557,845,793	10,142
4月末日	4,507,246,091	10,134
5月末日	4,474,224,693	10,167
6月末日	4,398,111,247	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
第10計算期間	100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10計算期間	2.22
第10計算期間末日から 平成23年6月末日までの期間	0.48

（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10計算期間末日から平成23年6月末日までの期間については平成23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。

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
--	------	------	-------

第1計算期間	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計算期間	174,493,381	1,058,127,984	4,783,240,165
第11計算期間期首から 平成23年6月30日までの期間	110,791,874	572,126,330	4,321,905,709

（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」

（１）投資状況

平成23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	4,593,854,076	99.05
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		44,257,419	0.95
純資産総額		4,638,111,495	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23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		1,687,945,228	0.8588 0.8368	1,449,617,489 1,412,472,566		30.45
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		1,165,349,902	1.1293 1.1442	1,316,038,967 1,333,393,357		28.75
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		912,195,584	1.2389 1.2534	1,130,192,084 1,143,345,944		24.65
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		478,142,275	0.9685 0.9938	463,120,871 475,177,792		10.25
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		145,580,775	1.5380 1.5762	223,903,231 229,464,417		4.95

（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23年6月30日現在

種類／業種別	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.05
合 計	99.05

（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23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)
第10計算期間末日 (平成22年12月13日)	5,027,987,355 (分配付) 5,027,987,355 (分配落)	9,817 (分配付) 9,817 (分配落)
平成22年 6月末日	5,308,292,676	9,613
7月末日	5,271,745,728	9,716
8月末日	5,147,260,770	9,596
9月末日	5,151,143,739	9,775
10月末日	4,963,335,515	9,604
11月末日	5,007,140,044	9,759
12月末日	5,019,057,488	9,881
平成23年 1月末日	4,996,361,120	9,945
2月末日	4,989,466,708	10,033
3月末日	4,841,865,498	9,854
4月末日	4,733,726,783	9,809
5月末日	4,679,756,660	9,776
6月末日	4,638,111,495	9,811

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
第10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10計算期間	2.16
第10計算期間末日から 平成23年6月末日までの期間	0.06

（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10計算期間末日から平成23年6月末日までの期間については平成23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。

（４）設定及び解約の実績

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	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計算期間	237,660,073	1,241,964,385	5,121,701,759
第11計算期間期首から 平成23年6月30日までの期間	106,823,478	501,157,671	4,727,367,566

（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」

（１）投資状況

平成23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	3,362,267,551	98.44
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		53,318,232	1.56
純資産総額		3,415,585,783	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23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		2,254,427,980	0.8603 0.8368	1,939,594,858 1,886,505,333		55.23
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		846,672,582	0.9674 0.9938	819,079,704 841,423,211		24.63
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		262,684,819	1.1296 1.1442	296,737,440 300,563,969		8.80
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		106,286,261	1.5380 1.5762	163,471,032 167,528,404		4.90
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		132,636,536	1.2389 1.2534	164,325,128 166,246,634		4.87

（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23年6月30日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
投資信託受益証券	98.44
合 計	98.44

（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23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)
第10計算期間末日 (平成22年12月13日)	3,584,666,826 (分配付) 3,584,666,826 (分配落)	8,777 (分配付) 8,777 (分配落)
平成22年 6月末日	3,448,738,847	8,295
7月末日	3,525,624,719	8,463
8月末日	3,380,905,275	8,130
9月末日	3,489,266,366	8,461
10月末日	3,387,634,150	8,244
11月末日	3,525,422,519	8,608
12月末日	3,586,355,972	8,861
平成23年 1月末日	3,630,867,510	8,991
2月末日	3,678,956,500	9,154
3月末日	3,545,343,038	8,870
4月末日	3,494,464,312	8,791
5月末日	3,404,749,182	8,635
6月末日	3,415,585,783	8,693

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
第10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10計算期間	1.66
第10計算期間末日から 平成23年6月末日までの期間	0.95

（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10計算期間末日から平成23年6月末日までの期間については平成23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。

（４）設定及び解約の実績

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	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計算期間	334,870,185	442,926,159	4,084,001,354
第11計算期間期首から 平成23年6月30日までの期間	186,176,540	341,099,182	3,929,078,712

（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。

[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

(2011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	9,110,389,117	100.05
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	4,640,230	0.05
合計（純資産総額）	-	9,105,748,887	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

(2011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	3,526,000,531	100.05
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	1,737,544	0.05
合計（純資産総額）	-	3,524,262,987	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

(2011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	3,340,852,388	100.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	860,115	0.03
合計（純資産総額）	-	3,339,992,273	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

(2011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	2,866,825,709	101.21
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	34,299,116	1.21
合計（純資産総額）	-	2,832,526,593	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

(2011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	618,696,409	100.04
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	259,376	0.04
合計（純資産総額）	-	618,437,033	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

(2011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	37,719,776,160	93.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,437,509,829	6.07
合計(純資産総額)	-	40,157,285,989	100.00

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

その他の資産の投資状況

(2011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	2,506,025,000	6.24

(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

(2011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	13,267,155,816	44.35
	カナダ	494,018,263	1.65
	ドイツ	1,577,435,505	5.27
	イタリア	229,064,180	0.77
	フランス	1,710,876,232	5.72
	オーストラリア	36,870,972	0.12
	イギリス	2,508,100,780	8.38
	スイス	2,694,678,072	9.01
	バミューダ	40,997,198	0.14
	香港	70,819,218	0.24
	シンガポール	30,787,192	0.10
	マレーシア	43,490,100	0.15
	オランダ	842,652,677	2.82
	スペイン	544,055,400	1.82
	ベルギー	211,122,056	0.71
	スウェーデン	315,458,912	1.05
	ノルウェー	35,506,396	0.12
	オーストリア	125,888,100	0.42
	タイ	48,705,800	0.16
	ルクセンブルク	171,430,779	0.57
	フィンランド	174,836,662	0.58
	デンマーク	254,244,265	0.85
	メキシコ	54,591,321	0.18
	ブラジル	388,873,840	1.30
	韓国	281,593,594	0.94
	アイルランド	260,568,259	0.87
	ギリシャ	31,907,805	0.11
	トルコ	15,732,100	0.05
	インド	60,395,399	0.20
	チェコ	35,254,926	0.12
	イスラエル	44,659,034	0.15
	南アフリカ	130,067,008	0.43
	ロシア	142,826,194	0.48

	ケイマン島	201,602,111	0.67
	モーリシャス	8,734,340	0.03
	パナマ	134,287,089	0.45
	キュラソー	48,428,183	0.16
	ジャージー	223,389,029	0.75
	小 計	27,491,104,807	91.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,422,494,251	8.10
合計(純資産総額)	-	29,913,599,058	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

(2011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	1,158,257,528	3.87
		ドイツ	386,590,844	1.29
		イギリス	226,907,352	0.76
		カナダ	126,170,616	0.42
		スイス	88,784,100	0.30
		オーストラリア	68,382,637	0.23
		香港	34,402,993	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

(2011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	493,292,100	4.16
国債証券	日本	8,043,038,245	67.88
社債券	日本	2,219,040,000	18.73
	アメリカ	100,687,000	0.85
	フランス	100,379,000	0.85
	オーストラリア	201,318,000	1.70
	韓国	99,973,000	0.84
	小 計	2,721,397,000	22.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	590,624,046	4.98
合計(純資産総額)	-	11,848,351,391	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

(2011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	シンガポール	141,350,000	1.19

(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

(2011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	360,820,763	2.73
	カナダ	151,853,239	1.15
	ドイツ	1,065,285,028	8.06
	イタリア	581,883,956	4.40
	オーストラリア	412,062,276	3.12
	イギリス	373,530,068	2.82
	マレーシア	23,306,725	0.18
	ニュージーランド	675,432,531	5.11
	オランダ	61,362,497	0.46
	メキシコ	318,257,057	2.41
	ブラジル	57,514,070	0.43
	韓国	28,436,593	0.22
	アイルランド	304,351,933	2.30
	チェコ	74,537,890	0.56
	ポーランド	445,249,272	3.37
	南アフリカ	35,840,670	0.27
	スロバキア	7,258,498	0.05
	スロベニア	56,594,375	0.43
	小 計	5,033,577,441	38.06
地方債証券	アメリカ	454,686,042	3.44
特殊債券	アメリカ	811,004,183	6.13
	ドイツ	147,418,985	1.11
	フランス	34,269,562	0.26
	オーストラリア	80,349,169	0.61
	オランダ	16,819,288	0.13
	スペイン	128,062,470	0.97
	スウェーデン	32,918,464	0.25
	ルクセンブルク	91,822,219	0.69
	デンマーク	32,515,815	0.25
	韓国	72,141,295	0.55
	アイルランド	26,215,560	0.20
	国際機関	247,353,412	1.87
	小 計	1,720,890,422	13.01
社債券	アメリカ	1,083,265,011	8.19
	イタリア	48,056,432	0.36
	フランス	556,122,837	4.21
	オーストラリア	871,687,046	6.59
	イギリス	1,165,941,724	8.82
	スイス	48,470,937	0.37
	ニュージーランド	33,887,011	0.26
	オランダ	421,133,827	3.18
	スウェーデン	116,189,574	0.88
	ノルウェー	91,874,470	0.69
	ルクセンブルク	27,185,827	0.21
	韓国	26,565,094	0.20
	インド	16,044,764	0.12
	ケイマン島	110,432,342	0.84
	ジャージー	70,683,059	0.53

	小 計	4,687,539,955	35.45
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,327,606,103	10.04
合計(純資産総額)	-	13,224,299,963	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

(2011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	ドイツ	2,629,977,264	19.89
		カナダ	248,539,104	1.88
		アメリカ	99,171,759	0.75
		イギリス	93,986,676	0.71

(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。

[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）

(2011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	9,890,770,945	0.9429	9,326,007,925	0.9211	9,110,389,117	100.05

(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。

投資有価証券種類別投資比率

(2011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

(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）

(2011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	3,481,781,901	0.9803	3,413,222,268	1.0127	3,526,000,531	100.05

(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。

投資有価証券種類別投資比率

(2011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

(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）

(2011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	2,746,959,701	1.1945	3,281,243,363	1.2162	3,340,852,388	100.03

(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。

投資有価証券種類別投資比率

(2011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

(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）

(2011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	1,524,582,913	1.8282	2,787,242,482	1.8804	2,866,825,709	101.21
----	---------------	----------------------	---------------	--------	---------------	--------	---------------	--------

(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。

投資有価証券種類別投資比率

(2011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	101.21
	合計	101.21

(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）

(2011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	329,023,830	1.8262	600,863,319	1.8804	618,696,409	100.04

(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。

投資有価証券種類別投資比率

(2011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	100.04
	合計	100.04

(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。

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。

（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

（2011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	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	3,231,700	381.02	1,231,362,905	390.00	1,260,363,000	3.14
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	331,600	3,225.80	1,069,676,163	3,300.00	1,094,280,000	2.72
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	233,000	3,700.20	862,148,578	3,865.00	900,545,000	2.24
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	5,650	148,167.43	837,145,979	143,000.00	807,950,000	2.01
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	304,200	2,464.59	749,728,278	2,468.00	750,765,600	1.87
日本	株式	三井物産	卸売業	526,100	1,400.00	736,540,000	1,384.00	728,122,400	1.81
日本	株式	オリックス	その他金融業	82,590	7,559.27	624,320,256	7,790.00	643,376,100	1.60
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	727,900	729.86	531,265,094	842.00	612,891,800	1.53
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	193,800	2,982.71	578,049,198	3,085.00	597,873,000	1.49
日本	株式	三菱商事	卸売業	297,000	2,157.59	640,804,230	2,000.00	594,000,000	1.48
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,108,000	398.99	442,081,636	473.00	524,084,000	1.31
日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	389,700	1,075.99	419,316,722	1,167.00	454,779,900	1.13
日本	株式	三菱電機	電気機器	488,000	856.78	418,108,640	930.00	453,840,000	1.13
日本	株式	キヤノン	電気機器	115,700	3,620.00	418,834,000	3,810.00	440,817,000	1.10
日本	株式	三井不動産	不動産業	302,000	1,353.37	408,719,119	1,378.00	416,156,000	1.04
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	89,100	4,514.74	402,263,716	4,600.00	409,860,000	1.02
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,316	312,794.85	411,638,022	309,500.00	407,302,000	1.01
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,958,800	127.33	376,757,941	132.00	390,561,600	0.97
日本	株式	東芝	電気機器	861,000	401.00	345,261,000	422.00	363,342,000	0.90
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	185,800	1,696.36	315,184,162	1,846.00	342,986,800	0.85
日本	株式	住友商事	卸売業	291,200	1,091.00	317,699,200	1,089.00	317,116,800	0.79

日本	株式	ファナック	電気機器	23,100	13,120.00	303,072,000	13,380.00	309,078,000	0.77
日本	株式	旭硝子	ガラス・土石製品	327,000	976.64	319,361,280	936.00	306,072,000	0.76
日本	株式	小松製作所	機械	120,600	2,752.00	331,891,200	2,497.00	301,138,200	0.75
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	742,300	399.92	296,862,313	396.00	293,950,800	0.73
日本	株式	ソニー	電気機器	135,100	2,357.34	318,476,774	2,117.00	286,006,700	0.71
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	431	621,147.91	267,714,749	632,000.00	272,392,000	0.68
日本	株式	東燃ゼネラル石油	石油・石炭製品	271,000	996.00	269,916,000	988.00	267,748,000	0.67
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	104,900	2,486.14	260,796,086	2,499.00	262,145,100	0.65
日本	株式	J S R	化学	157,000	1,471.48	231,022,964	1,552.00	243,664,000	0.61

(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。

投資有価証券種類別及び業種別投資比率

(2011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	0.37
		建設業	2.42
		食料品	1.88
		繊維製品	0.55
		パルプ・紙	0.15
		化学	7.46
		医薬品	3.43
		石油・石炭製品	1.82
		ゴム製品	1.57
		ガラス・土石製品	2.43
		鉄鋼	1.66
		非鉄金属	2.47
		金属製品	1.14
		機械	4.06
		電気機器	10.72
		輸送用機器	8.13
		精密機器	0.26
		その他製品	1.31
		電気・ガス業	3.22
		陸運業	2.91
		海運業	0.26
		倉庫・運輸関連業	0.28
		情報・通信業	7.01
		卸売業	6.40
		小売業	3.52
		銀行業	9.58
		証券、商品先物取引業	1.10
		保険業	1.08
		その他金融業	2.80
		不動産業	1.74
		サービス業	2.19
	合計		93.93

(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

(2011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	114,533	5,283.58	605,145,413	5,019.74	574,927,026	1.92
スイス	株式	CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	耐久消費財・アパレル	70,708	4,976.09	351,850,078	5,286.50	373,797,842	1.25
スイス	株式	JULIUS BAER GROUP LTD	各種金融	111,083	3,790.75	421,088,993	3,286.35	365,058,727	1.22
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	110,342	3,345.83	369,185,935	3,095.99	341,618,335	1.14
イギリス	株式	DIAGEO PLC	食品・飲料・タバコ	201,649	1,571.63	316,918,787	1,640.41	330,788,891	1.11
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	10,984	26,861.29	295,044,441	26,967.04	296,206,068	0.99
ドイツ	株式	LINDE AG	素材	20,454	13,465.80	275,429,677	13,968.22	285,706,012	0.96
アメリカ	株式	STATE STREET CORP	各種金融	75,566	3,666.75	277,082,129	3,645.76	275,496,014	0.92
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	144,710	1,594.41	230,728,156	1,726.81	249,887,355	0.84
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	93,398	2,758.54	257,642,501	2,618.07	244,522,866	0.82
アメリカ	株式	DIRECTV-CLASS A	メディア	60,396	3,850.01	232,525,427	4,046.99	244,422,303	0.82
オランダ	株式	HEINEKEN NV	食品・飲料・タバコ	50,692	4,696.96	238,098,701	4,806.79	243,666,183	0.81
スペイン	株式	INDITEX	小売	33,213	6,943.29	230,607,637	7,331.70	243,508,084	0.81
オランダ	株式	AKZO NOBEL	素材	47,632	5,650.36	269,137,969	5,094.80	242,675,904	0.81
スイス	株式	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	運輸	19,535	12,615.81	246,450,043	12,066.80	235,724,938	0.79
フランス	株式	DANONE	食品・飲料・タバコ	38,893	5,679.59	220,896,387	6,039.45	234,892,702	0.79
アメリカ	株式	NATIONAL OILWELL VARCO INC	エネルギー	36,680	6,175.84	226,529,994	6,119.33	224,457,171	0.75
アメリカ	株式	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	銀行	46,925	4,997.52	234,508,831	4,758.22	223,279,764	0.75
スイス	株式	UBS AG-REG	各種金融	146,259	1,601.46	234,229,400	1,455.00	212,806,845	0.71
イギリス	株式	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	家庭用品・パーソナル用品	48,073	4,152.95	199,645,246	4,412.51	212,123,073	0.71
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	38,964	5,442.81	212,073,906	5,341.90	208,141,951	0.70
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	28,670	6,201.67	177,802,125	6,988.79	200,368,784	0.67
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	半導体・半導体製造装置	3,170	67,110.72	212,740,997	62,974.80	199,630,116	0.67
カナダ	株式	ULTRA PETROLEUM CORP	エネルギー	53,759	3,883.92	208,795,671	3,702.27	199,030,752	0.67
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	108,388	1,632.63	176,957,760	1,716.34	186,030,714	0.62
アメリカ	株式	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	各種金融	43,805	4,038.92	176,924,973	4,218.94	184,811,095	0.62
イギリス	株式	ASTRAZENECA PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	46,133	3,912.86	180,512,293	4,005.65	184,793,098	0.62
スイス	株式	GIVAUDAN-REG	素材	2,132	89,919.00	191,707,308	85,457.00	182,194,324	0.61
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	43,040	3,835.48	165,079,158	4,160.82	179,081,873	0.60
ドイツ	株式	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	自動車・自動車部品	21,597	6,920.66	149,465,654	8,045.60	173,760,875	0.58

(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。

投資有価証券種類別及び業種別投資比率

(2011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	6.87
		素材	7.05
		資本財	5.90

		商業・専門サービス	0.81
		運輸	2.55
		自動車・自動車部品	2.28
		耐久消費財・アパレル	3.11
		消費者サービス	2.57
		メディア	5.11
		小売	3.36
		食品・生活必需品小売り	1.30
		食品・飲料・タバコ	8.47
		家庭用品・パーソナル用品	1.77
		ヘルスケア機器・サービス	4.49
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.58
		銀行	5.94
		各種金融	7.54
		保険	1.96
		不動産	0.51
		ソフトウェア・サービス	4.98
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.34
		電気通信サービス	2.32
		公益事業	0.86
		半導体・半導体製造装置	3.22
	合計		91.90

(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

(2011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85回 利付国債(5年)	960,000,000	101.24	971,985,000	101.40	973,449,600	0.7	2014年9月20日	8.22
日本	国債証券	第305回 利付国債(10年)	776,000,000	102.57	795,997,790	103.10	800,087,040	1.3	2019年12月20日	6.75
日本	国債証券	第74回 利付国債(20年)	530,000,000	107.18	568,054,000	107.44	569,437,300	2.1	2024年12月20日	4.81
日本	国債証券	第88回 利付国債(5年)	550,000,000	100.73	554,032,800	100.67	553,723,500	0.5	2015年3月20日	4.67
日本	国債証券	第121回 利付国債(20年)	417,000,000	99.26	413,933,120	100.42	418,768,080	1.9	2030年9月20日	3.53
日本	国債証券	第114回 利付国債(20年)	373,000,000	103.01	384,227,300	103.94	387,696,200	2.1	2029年12月20日	3.27
日本	国債証券	第270回 利付国債(10年)	350,000,000	104.08	364,285,000	103.79	363,265,000	1.3	2015年6月20日	3.07
日本	国債証券	第309回 利付国債(10年)	340,000,000	100.39	341,338,000	100.90	343,077,000	1.1	2020年6月20日	2.90
日本	国債証券	第95回 利付国債(20年)	250,000,000	105.92	264,800,000	108.41	271,040,000	2.3	2027年6月20日	2.29
日本	国債証券	第284回 利付国債(2年)	235,000,000	100.12	235,294,000	100.03	235,086,950	0.3	2011年9月15日	1.98
日本	国債証券	第96回 利付国債(5年)	230,000,000	100.32	230,753,500	100.43	231,007,400	0.5	2016年3月20日	1.95
日本	国債証券	第90回 利付国債(20年)	210,000,000	107.21	225,153,200	107.53	225,827,700	2.2	2026年9月20日	1.91
日本	国債証券	第288回 利付国債(10年)	210,000,000	106.75	224,189,500	106.77	224,233,800	1.7	2017年9月20日	1.89
日本	国債証券	第315回 利付国債(10年)	210,000,000	100.50	211,056,650	100.62	211,314,600	1.2	2021年6月20日	1.78
日本	国債証券	第88回 利付国債(20年)	170,000,000	108.30	184,116,800	108.97	185,257,500	2.3	2026年6月20日	1.56
日本	国債証券	第299回 利付国債(2年)	180,000,000	100.06	180,123,600	100.08	180,154,800	0.2	2012年12月15日	1.52
日本	国債証券	第84回 利付国債(20年)	157,000,000	104.66	164,325,620	105.37	165,441,890	2	2025年12月20日	1.40

日本	国債証券	第 8 7 回 利付国債（ 5 年）	140,000,000	100.72	141,020,600	100.71	141,006,600	0.5	2014年12月20日	1.19
日本	国債証券	第 3 3 回 利付国債（ 3 0 年）	139,000,000	97.80	135,951,730	99.17	137,856,030	2	2040年9月20日	1.16
日本	国債証券	第 3 1 3 回 利付国債（ 1 0 年）	135,000,000	101.59	137,146,500	101.79	137,427,300	1.3	2021年3月20日	1.16
日本	国債証券	第 9 1 回 利付国債（ 2 0 年）	110,000,000	106.27	116,897,000	108.82	119,711,900	2.3	2026年9月20日	1.01
日本	国債証券	第 1 2 回 利付国債（物価連動 1 0 年）	115,000,000	100.00	114,425,000	103.70	119,374,255	1.2	2017年6月10日	1.01
日本	国債証券	第 8 6 回 利付国債（ 2 0 年）	100,000,000	108.53	108,532,000	109.11	109,113,000	2.3	2026年3月20日	0.92
日本	国債証券	第 1 4 回 利付国債（ 3 0 年）	100,000,000	106.44	106,445,000	108.01	108,017,000	2.4	2034年3月20日	0.91
日本	社債券	第 1 3 3 回 オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	105.29	105,296,000	105.97	105,976,000	2.54	2015年4月8日	0.89
日本	社債券	第 1 回 西日本シティ銀行無担保社債	100,000,000	106.12	106,122,000	104.68	104,685,000	2.78	2015年4月15日	0.88
日本	社債券	第 4 9 回 日本電信電話社債	100,000,000	104.40	104,407,000	103.92	103,925,000	1.45	2015年9月18日	0.88
日本	社債券	第 4 回 株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	104.10	104,107,000	103.80	103,802,000	1.81	2016年1月29日	0.88
日本	社債券	第 9 回 東京建物株式会社無担保社債	100,000,000	103.52	103,526,000	103.20	103,201,000	1.92	2015年11月20日	0.87
日本	国債証券	第 8 1 回 利付国債（ 5 年）	100,000,000	101.62	101,625,000	101.57	101,574,000	0.8	2014年3月20日	0.86

(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。

投資有価証券種類別投資比率

(2011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	4.16
	国債証券	67.88
	社債券	18.73
外国	社債券	4.24
	合計	95.02

(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

(2011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	BUNDESREPUB	2,200,000	13,517.21	297,378,831	13,349.90	293,697,903	4.75	2028年7月4日	2.22
ニュージーランド	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4,030,000	7,026.83	283,181,426	7,202.88	290,276,344	6	2017年12月15日	2.20
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,500,000	11,602.74	290,068,685	11,602.74	290,068,685	0	2011年11月30日	2.19
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB	1,500,000	14,640.63	219,609,543	14,571.23	218,568,498	5.5	2031年1月4日	1.65
アメリカ	社債券	MERRILL LYNCH	1,900,000	11,166.04	212,154,917	11,298.32	214,668,134	1.734	2014年8月25日	1.62
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT	7,230,000	2,887.52	208,767,818	2,950.45	213,318,140	5.5	2015年4月25日	1.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,260,000	8,639.19	195,245,752	8,783.82	198,514,504	3.75	2018年11月15日	1.50
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB	1,200,000	15,940.13	191,281,568	15,871.77	190,461,351	6.5	2027年7月4日	1.44
ニュージーランド	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2,640,000	6,920.57	182,703,175	7,173.74	189,386,745	6	2021年5月15日	1.43
イギリス	社債券	ROYAL BANK OF SCOTLAND	1,400,000	13,264.29	185,700,125	13,130.08	183,821,248	4.125	2011年11月14日	1.39
フランス	社債券	DEXIA CREDIT LOCAL	2,200,000	8,026.01	176,572,333	8,041.67	176,916,888	0.75275	2014年4月29日	1.34
オーストラリア	社債券	MACQUARIE BK LTD	2,000,000	8,731.67	174,633,521	8,682.02	173,640,542	4.1	2013年12月17日	1.31
イギリス	国債証券	TSY	1,200,000	14,066.99	168,803,937	13,963.54	167,562,591	4.75	2030年12月7日	1.27
アメリカ	特殊債券	FNMA TBA	2,000,000	8,149.94	162,998,915	8,093.18	161,863,650	4	2041年7月14日	1.22
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT	5,500,000	2,924.80	160,864,347	2,935.20	161,436,102	5.25	2013年4月25日	1.22
イギリス	社債券	ABBAY NATL TREASURY SERV	1,400,000	11,240.35	157,365,019	11,508.89	161,124,486	3.625	2016年10月14日	1.22
アメリカ	社債券	CITIGROUP INC	1,600,000	9,995.18	159,922,900	9,978.38	159,654,231	8.5	2019年5月22日	1.21
オーストラリア	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,770,000	8,819.76	156,109,876	9,010.17	159,480,079	5.75	2021年5月15日	1.21
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,340,000	11,831.21	158,538,326	11,708.30	156,891,256	4.5	2018年2月1日	1.19
オーストラリア	社債券	NATL AUSTRALIA BANK	1,790,000	8,710.64	155,920,490	8,758.65	156,779,836	5.75	2013年12月19日	1.19
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB	1,050,000	14,676.11	154,099,166	14,596.35	153,261,715	5.625	2028年1月4日	1.16
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	17,760,000	794.66	141,132,042	838.30	148,882,364	10	2036年11月20日	1.13
メキシコ	国債証券	MEXICAN FIXED RATE BONDS	20,130,000	645.25	129,889,147	685.30	137,951,222	7.5	2027年6月3日	1.04
アメリカ	社債券	JPM CHASE CAPITAL XXII	1,600,000	8,243.25	131,892,153	8,126.03	130,016,633	6.45	2037年2月2日	0.98
アメリカ	特殊債券	FANNIE DISCOUNT NOTE	1,600,000	8,072.94	129,167,137	8,072.94	129,167,137	-	2011年7月12日	0.98
アメリカ	特殊債券	FED HOME LN DISCOUNT NT	1,600,000	8,072.19	129,155,167	8,072.19	129,155,167	-	2011年8月24日	0.98
スペイン	特殊債券	INSTIT CRDT OFCL	1,100,000	11,663.08	128,293,942	11,642.04	128,062,470	3.875	2013年5月16日	0.97
イギリス	国債証券	TSY	900,000	13,550.64	121,955,823	13,436.77	120,930,950	4.5	2034年9月7日	0.91
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,380,000	8,552.93	118,030,569	8,541.63	117,874,599	3.375	2013年6月30日	0.89
ドイツ	国債証券	BUNDESOBLIGATION	920,000	12,321.47	113,357,607	12,310.61	113,257,638	4	2013年10月11日	0.86

(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。

投資有価証券種類別投資比率

(2011年6月30日現在)

国内 / 外国	種類	投資比率（％）
外国	国債証券	38.06
	地方債証券	3.44
	特殊債券	13.01
	社債券	35.45
	合計	89.96

(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。

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

(2011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	2011年9月	買建	295	2,375,399,000	2,506,025,000	6.24

(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

(2011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	2011年9月	買建	175	897,306,684	921,341,216	3.08
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	2011年9月	買建	118	377,413,764	386,590,844	1.29
シカゴ商業取引所	S&P 500 株価指数先物取引	2011年9月	買建	9	231,136,933	236,916,312	0.79
ロンドン国際金融先物オブ ション取引所	FTSE 100 株価指数先物取引	2011年9月	買建	30	222,674,046	226,907,352	0.76
モントリオール取引所	S&P/TSE 60 株価指数先物取引	2011年9月	買建	10	124,136,475	126,170,616	0.42
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	2011年9月	買建	15	89,439,820	88,784,100	0.30
シドニー先物取引所	SPI 200 株価指数先物取引	2011年9月	買建	7	68,488,987	68,382,637	0.23
香港先物取引所	HANG SENG 株価指数先物取引	2011年7月	買建	3	34,347,518	34,402,993	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

(2011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	2011年9月	買建	100,000,000	141,314,650	141,350,000	1.19

(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

(2011年6月30日現在)

種類	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 (%)
債券先物	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND 債券先物取引	2011年9月	買建	176	2,576,462,161	2,588,987,456	19.58
	モントリオール取引所	CAN 10YR BOND 債券先物取引	2011年9月	買建	24	248,107,763	248,539,104	1.88
	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE 債券先物取引	2011年9月	買建	10	100,371,173	99,171,759	0.75
	ロンドン国際金融先物オプション取引所	LONG GILT 債券先物取引	2011年9月	買建	6	93,418,824	93,986,676	0.71
	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL 債券先物取引	2011年9月	買建	3	41,063,716	40,989,808	0.31

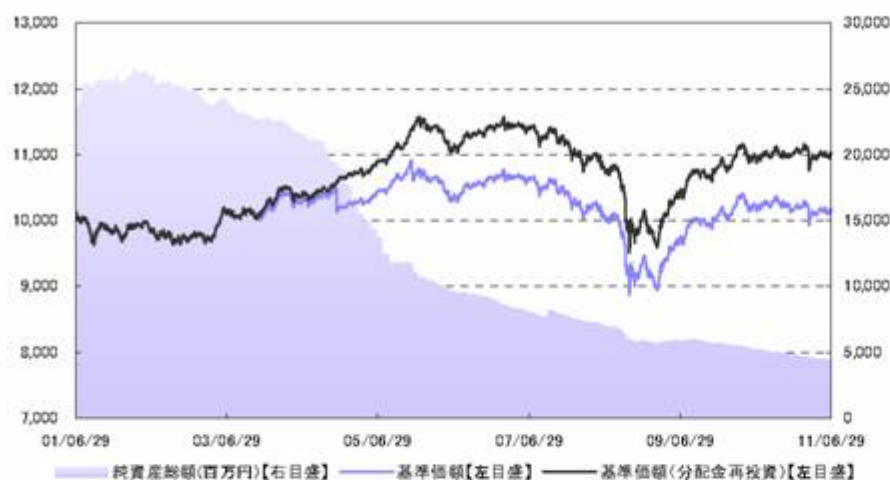
(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

[参考情報]

運用実績

三菱 UFJ MV20

1 基準価額・純資産の推移(2001年06月29日～2011年06月30日)



- ・基準価額(分配金再投資)はグラフの起点における基準価額に合わせて指数化
- ・基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を再投資したものと計算

2 分配の推移

2010 年 12 月	100円
2009 年 12 月	0円
2008 年 12 月	0円
2007 年 12 月	0円
2006 年 12 月	0円
2005 年 12 月	300円
設定来累計	836円

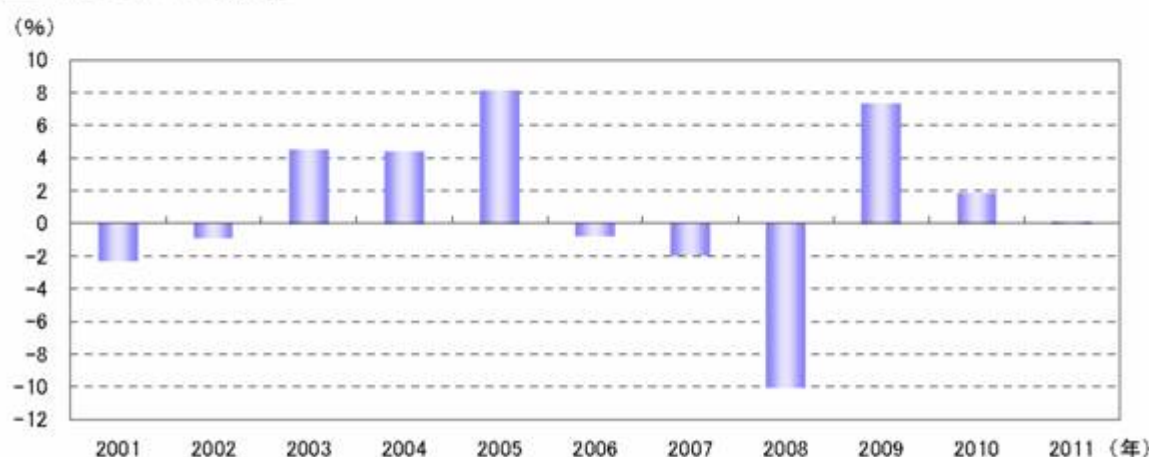
・分配金は1万口当たり、税引前

3 主要な資産の状況(2011年06月30日現在)

	組入上位銘柄	資産クラス	比率
1	ラッセル 日本債券ファンド I I (適格機関投資家限定)	日本債券	38.9%
2	ラッセル 外国債券ファンド I I Aコース(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	外国債券	34.6%
3	ラッセル 日本株式ファンド I I (適格機関投資家限定)	日本株式	15.4%
4	ラッセル 外国株式ファンド I I (適格機関投資家限定)	外国株式	5.2%
5	ラッセル 外国債券ファンド I I Bコース(為替ヘッジなし)(適格機関投資家限定)	外国債券	5.0%

・各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

4 年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2011年は6月30日までの収益率を表示

- ・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
- ・ファンドの運用状況等は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

三菱UFJ MV40

1 基準価額・純資産の推移(2001年06月29日～2011年06月30日)



- ・基準価額(分配金再投資)はグラフの起点における基準価額に合わせて指数化
- ・基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を再投資したものと計算

2 分配の推移

2010 年 12月	0円
2009 年 12月	0円
2008 年 12月	0円
2007 年 12月	0円
2006 年 12月	0円
2005 年 12月	500円
設定来累計	800円

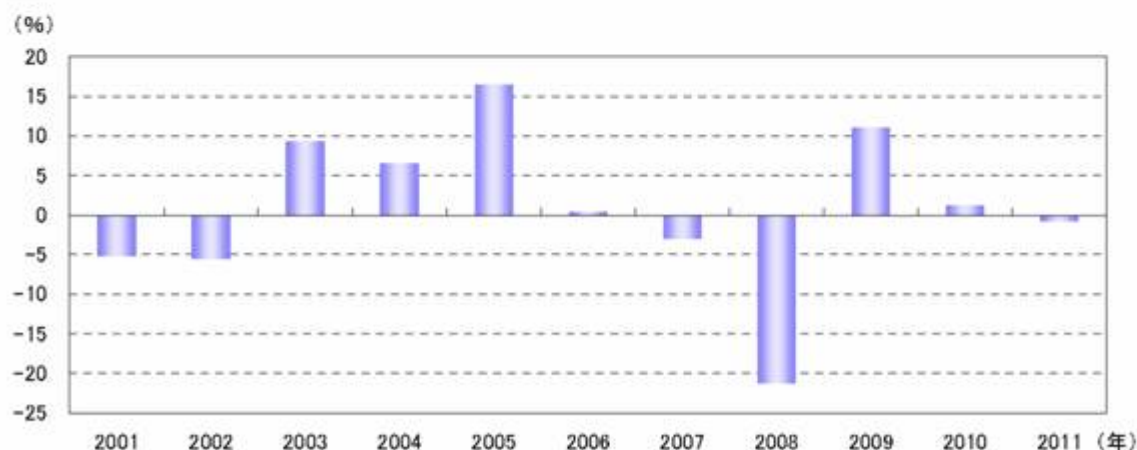
・分配金は1万口当たり、税引前

3 主要な資産の状況(2011年06月30日現在)

	組入上位銘柄	資産クラス	比率
1	ラッセル 日本株式ファンド I I (適格機関投資家限定)	日本株式	30.5%
2	ラッセル 日本債券ファンド I I (適格機関投資家限定)	日本債券	28.7%
3	ラッセル 外国債券ファンド I I Aコース(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	外国債券	24.7%
4	ラッセル 外国株式ファンド I I (適格機関投資家限定)	外国株式	10.2%
5	ラッセル 外国債券ファンド I I Bコース(為替ヘッジなし)(適格機関投資家限定)	外国債券	4.9%

・各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

4 年間収益率の推移

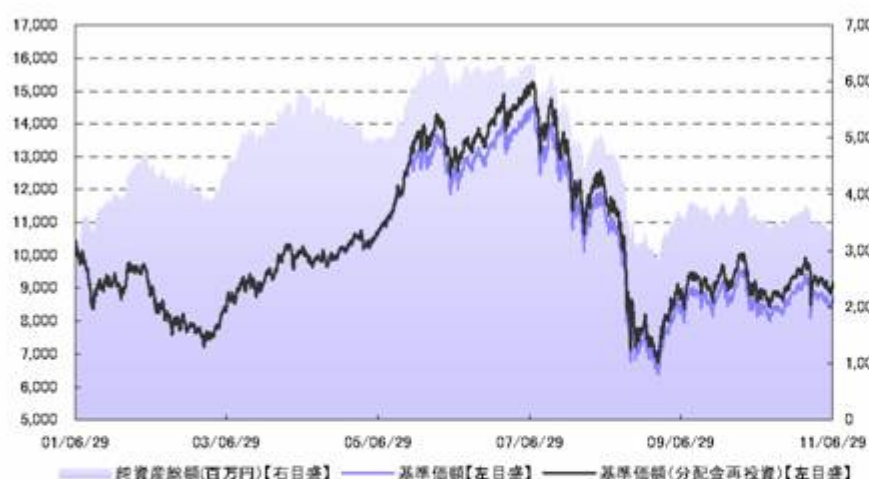


- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2011年は6月30日までの収益率を表示

- ・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
- ・ファンドの運用状況等は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

三菱UFJ MV80

1 基準価額・純資産の推移(2001年06月29日～2011年06月30日)



- ・基準価額(分配金再投資)はグラフの起点における基準価額に合わせて指数化
- ・基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を再投資したものと計算

2 分配の推移

2010 年 12 月	0円
2009 年 12 月	0円
2008 年 12 月	0円
2007 年 12 月	0円
2006 年 12 月	100円
2005 年 12 月	500円
設定来累計	650円

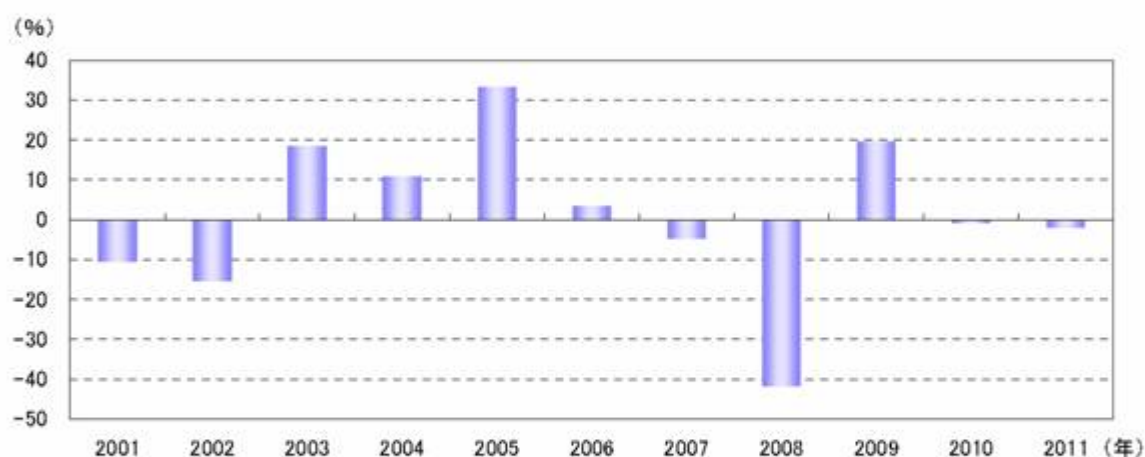
・分配金は1万口当たり、税引前

3 主要な資産の状況(2011年06月30日現在)

	組入上位銘柄	資産クラス	比率
1	ラッセル 日本株式ファンド I I (適格機関投資家限定)	日本株式	55.2%
2	ラッセル 外国株式ファンド I I (適格機関投資家限定)	外国株式	24.6%
3	ラッセル 日本債券ファンド I I (適格機関投資家限定)	日本債券	8.8%
4	ラッセル 外国債券ファンド I I Bコース(為替ヘッジなし)(適格機関投資家限定)	外国債券	4.9%
5	ラッセル 外国債券ファンド I I Aコース(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	外国債券	4.9%

・各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

4 年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2011年は6月30日までの収益率を表示

- ・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
- ・ファンドの運用状況等は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

[前へ](#)

第3【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、「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、前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）および第11期中間計算期間（平成22年12月14日から平成23年6月13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 10 期中間計算期間末 [平成22年6月14日現在]	第 11 期中間計算期間末 [平成23年6月13日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	66,803,992	58,320,588
投資信託受益証券	5,242,582,891	4,403,921,640
未収利息	188	130
流動資産合計	5,309,387,071	4,462,242,358
資産合計	5,309,387,071	4,462,242,358
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,828,120	6,237,748
未払受託者報酬	577,447	485,193
未払委託者報酬	19,633,016	16,496,683
流動負債合計	25,038,583	23,219,624
負債合計	25,038,583	23,219,624
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 5,178,711,356	¹ 4,381,518,659
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	105,637,132	57,504,075
（分配準備積立金）	220,210,128	136,382,571
元本等合計	5,284,348,488	4,439,022,734
純資産合計	5,284,348,488	4,439,022,734
負債純資産合計	5,309,387,071	4,462,242,358

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	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	第 11 期中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13日
営業収益		
受取利息	29,543	19,293
有価証券売買等損益	131,582,108	20,848,146
営業収益合計	131,611,651	20,867,439
営業費用		
受託者報酬	577,447	485,193
委託者報酬	19,633,016	16,496,683
営業費用合計	20,210,463	16,981,876
営業利益	111,401,188	3,885,563
経常利益	111,401,188	3,885,563
中間純利益	111,401,188	3,885,563
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	9,618,099	2,574,239
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,446,680	60,560,670
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,407,363	1,648,164
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	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	1,648,164
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	6,016,083
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	6,016,083
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	105,637,132	57,504,075

(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 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)	第 11 期中間計算期間 (自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	(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。 (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。 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。 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。 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。	(1) 投資信託受益証券 同 左 (2) 投資信託受益証券以外の有価証券 同 左 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 同 左
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年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。	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22年12月14日から平成23年6月13日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第 10 期中間計算期間末 [平成22年6月14日現在]	第 11 期中間計算期間末 [平成23年6月13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	5,666,874,768円 75,011,305円 563,174,717円	4,783,240,165円 102,700,793円 504,422,299円
2 中間計算期間末日における受益権の総数	5,178,711,356口	4,381,518,659口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0204円 (10,204円)	1.0131円 (10,131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。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 11 期中間計算期間末 [平成23年6月13日現在]
1 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末の時価で計上しているためその差額はありません。
2 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記) に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券関係に関する注記)

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 10 期中間計算期間末 [平成22年6月14日現在]	第 11 期中間計算期間末 [平成23年6月13日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	80,595,381	57,911,498
投資信託受益証券	5,364,028,507	4,598,511,070
未収入金	21,000,000	-
未収利息	226	129
流動資産合計	5,465,624,114	4,656,422,697
資産合計	5,465,624,114	4,656,422,697
負債の部		
流動負債		
未払解約金	37,374,155	5,421,771
未払受託者報酬	603,399	511,391
未払委託者報酬	22,627,387	19,176,900
流動負債合計	60,604,941	25,110,062
負債合計	60,604,941	25,110,062
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 5,567,466,325	¹ 4,771,456,193
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	² 162,447,152	² 140,143,558
（分配準備積立金）	457,482,556	376,375,191
元本等合計	5,405,019,173	4,631,312,635
純資産合計	5,405,019,173	4,631,312,635
負債純資産合計	5,465,624,114	4,656,422,697

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	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	第 11 期中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13日
営業収益		
受取利息	31,127	20,663
有価証券売買等損益	90,125,254	31,269,555
営業収益合計	90,156,381	31,248,892
営業費用		
受託者報酬	603,399	511,391
委託者報酬	22,627,387	19,176,900
営業費用合計	23,230,786	19,688,291
営業利益	66,925,595	50,937,183
経常利益	66,925,595	50,937,183
中間純利益	66,925,595	50,937,183
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	14,660,059	2,839,596
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	239,367,578	93,714,404
剰余金増加額又は欠損金減少額	26,602,940	8,477,300
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	26,602,940	8,477,300
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,948,050	1,129,675
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,948,050	1,129,675
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	162,447,152	140,143,558

(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 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)	第 11 期中間計算期間 (自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	(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。 (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。 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。 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。 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。	(1) 投資信託受益証券 同 左 (2) 投資信託受益証券以外の有価証券 同 左 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 同 左
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年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。	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22年12月14日から平成23年6月13日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第 10 期中間計算期間末 [平成22年6月14日現在]	第 11 期中間計算期間末 [平成23年6月13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	6,126,006,071円 113,696,702円 672,236,448円	5,121,701,759円 96,297,843円 446,543,409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。	162,447,152円	140,143,558円
3 中間計算期間末日における受益権の総数	5,567,466,325口	4,771,456,193口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9708円 (9,708円)	0.9706円 (9,706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。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 11 期中間計算期間末 [平成23年6月13日現在]
1 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額 2 時価の算定方法	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末の時価で計上しているためその差額はありません。 (1) 有価証券 売買目的有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記) に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券関係に関する注記）
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 10 期中間計算期間末 [平成22年6月14日現在]	第 11 期中間計算期間末 [平成23年6月13日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	61,344,783	52,351,698
投資信託受益証券	3,511,851,172	3,319,395,588
未収利息	172	116
流動資産合計	3,573,196,127	3,371,747,402
資産合計	3,573,196,127	3,371,747,402
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,508,709	6,807,148
未払受託者報酬	390,354	372,867
未払委託者報酬	17,566,052	16,779,094
流動負債合計	20,465,115	23,959,109
負債合計	20,465,115	23,959,109
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 4,170,064,734	¹ 3,941,615,889
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	² 617,333,722	² 593,827,596
（分配準備積立金）	609,332,562	531,973,594
元本等合計	3,552,731,012	3,347,788,293
純資産合計	3,552,731,012	3,347,788,293
負債純資産合計	3,573,196,127	3,371,747,402

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	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	第 11 期中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13日
営業収益		
受取利息	23,588	16,534
有価証券売買等損益	27,942,636	94,391,059
営業収益合計	27,919,048	94,374,525
営業費用		
受託者報酬	390,354	372,867
委託者報酬	17,566,052	16,779,094
営業費用合計	17,956,406	17,151,961
営業利益	45,875,454	111,526,486
経常利益	45,875,454	111,526,486
中間純利益	45,875,454	111,526,486
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	5,888,003	2,115,252
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	572,946,327	499,334,528
剰余金増加額又は欠損金減少額	26,811,940	37,756,043
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	26,811,940	37,756,043
剰余金減少額又は欠損金増加額	19,435,878	18,607,373
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	19,435,878	18,607,373
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	617,333,722	593,827,596

(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 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)	第 11 期中間計算期間 (自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	(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。 (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。 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。 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。 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。	(1) 投資信託受益証券 同 左 (2) 投資信託受益証券以外の有価証券 同 左 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 同 左
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年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。	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22年12月14日から平成23年6月13日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第 10 期中間計算期間末 [平成22年6月14日現在]	第 11 期中間計算期間末 [平成23年6月13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	4,192,057,328円 173,799,902円 195,792,496円	4,084,001,354円 165,423,608円 307,809,073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。	617,333,722円	593,827,596円
3 中間計算期間末日における受益権の総数	4,170,064,734口	3,941,615,889口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8520円 (8,520円)	0.8493円 (8,493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。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 11 期中間計算期間末 [平成23年6月13日現在]
1 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額 2 時価の算定方法	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末の時価で計上しているためその差額はありません。 (1) 有価証券 売買目的有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記) に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券関係に関する注記）
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22年6月11日現在	当中間計算期間末 平成23年6月13日現在
	金 額	金 額
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	9,786,149,395	8,858,980,556
未収入金	28,000,000	-
流動資産合計	9,814,149,395	8,858,980,556
資産合計	9,814,149,395	8,858,980,556
負債の部		
流動負債		
未払解約金	28,000,000	-
未払受託者報酬	3,456,413	3,041,775
未払委託者報酬	25,992,190	22,874,102
流動負債合計	57,448,603	25,915,877
負債合計	57,448,603	25,915,877
純資産の部		
元本等		
元本	11,571,243,666	10,956,330,512
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,814,542,874	2,123,265,833
（分配準備積立金）	2,080,222,108	1,645,684,343
元本等合計	9,756,700,792	8,833,064,679
純資産合計	9,756,700,792	8,833,064,679
負債純資産合計	9,814,149,395	8,858,980,556

(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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13日
	金 額	金 額
営業収益		
有価証券売買等損益	50,027,732	620,464,687
営業収益合計	50,027,732	620,464,687
営業費用		
受託者報酬	6,931,166	6,166,907
委託者報酬	52,122,337	46,375,062
営業費用合計	59,053,503	52,541,969
営業利益又は営業損失（ ）	109,081,235	673,006,656
経常利益又は経常損失（ ）	109,081,235	673,006,656
中間純利益又は中間純損失（ ）	109,081,235	673,006,656
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（ ）	105,209,614	6,478,631
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,763,182,847	1,439,882,161
剰余金増加額又は欠損金減少額	272,877,609	188,105,161
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	272,877,609	188,105,161
剰余金減少額又は欠損金増加額	109,946,787	192,003,546
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	109,946,787	192,003,546
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,814,542,874	2,123,265,833

(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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13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.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項		計算期間末日の取扱い 平成22年12月11日及び平成22年12月12日が休日のため、信託約款第41条により、前計算期間末日を平成22年12月13日としており、このため中間計算期間は182日となっております。

(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22年6月11日現在	当中間計算期間末 平成23年6月13日現在
1.期首元本額	12,728,964,840円	11,252,953,454円
期中追加設定元本額	813,946,794円	1,163,003,561円
期中一部解約元本額	1,971,667,968円	1,459,626,503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1,814,542,874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2,123,265,833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	11,571,243,666口	10,956,330,512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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	前中間計算期間末 平成22年6月11日現在	当中間計算期間末 平成23年6月13日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額		中間貸借対照表計上額は、原則として中間計算期間末日の時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項		有価証券以外の金融商品 有価証券以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。 有価証券 「中間注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「1. 有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		金融商品の時価には、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一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

前中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13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22年6月11日現在	当中間計算期間末 平成23年6月13日現在
一口当たり純資産額 （一万口当たり純資産額）	0.8432円 (8,432円)	0.8062円 (8,062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22年6月11日現在	平成23年6月13日現在
	金 額	金 額
資産の部		
流動資産		
金銭信託	862,695	58,809
コール・ローン	2,932,990,815	3,067,145,981
株式	48,362,538,220	36,005,461,230
投資証券	22,536,000	-
派生商品評価勘定	48,944,085	28,574,000
未収入金	471,592,723	285,174,980
未収配当金	373,855,245	366,987,042
未収利息	8,839	7,562
差入委託証拠金	118,569,715	299,776,000
流動資産合計	52,331,898,337	40,053,185,604
資産合計	52,331,898,337	40,053,185,604
負債の部		
流動負債		
未払金	573,213,388	294,406,606
未払解約金	29,290,081	352,934
流動負債合計	602,503,469	294,759,540
負債合計	602,503,469	294,759,540
純資産の部		
元本等		
元本	56,803,605,813	45,147,309,039
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,074,210,945	5,388,882,975
元本等合計	51,729,394,868	39,758,426,064
純資産合計	51,729,394,868	39,758,426,064
負債純資産合計	52,331,898,337	40,053,185,604

（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22年6月11日及び平成23年6月13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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>有価証券 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 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当期末日の最終相場（外貨建証券の場合は当期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。 当期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当期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、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。 	<p>有価証券 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 同左
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、原則として当期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>

（注）「当期間」とは、当親投資信託の計算期間の開始日から本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を指しております。

（貸借対照表に関する注記）

平成22年6月11日現在		平成23年6月13日現在	
1. 本書における開示対象ファンドの期首における		1. 本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	当該親投資信託の元本額	58,448,305,784円
期中追加設定元本額	4,583,294,798円	期中追加設定元本額	1,715,466,185円
期中一部解約元本額	4,096,126,135円	期中一部解約元本額	15,016,462,930円
元本の内訳		元本の内訳	
ラッセル 日本株式ファンド - 2		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	（適格機関投資家限定）	25,626,833,052円
ラッセル 日本株式ファンド		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	（適格機関投資家限定）	10,060,164,157円
ラッセル 日本株式ファンド - 3		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	（適格機関投資家限定）	5,381,253,927円
ラッセル 日本株式マルチ・マネージャー・ファンド		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	（確定拠出年金向け）	2,360,059,481円
ラッセル 日本株式ファンド - 4		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	（適格機関投資家限定）	1,026,025,926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	39,007,401円	安定型	43,084,530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	359,974,840円	安定・成長型	412,550,630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	227,663,488円	成長型	237,337,336円
計	56,803,605,813円	計	45,147,309,039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5,074,210,945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5,388,882,975円であります。	
3. 本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		3. 本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		受益権の総数	
56,803,605,813口		45,147,309,039口	

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成22年6月11日現在	平成23年6月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額 2. 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 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		<p>貸借対照表計上額は、原則として期末の時価で計上しているため、その差額はありません。</p> <p>有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「1. 有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」の「取引の時価等に関する事項」に記載しております。</p> <p>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一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（有価証券に関する注記）

自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日	自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13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	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

株式関連（平成23年6月13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	株価指数先物取引				
	買 建	3,663,205,000		3,692,325,000	29,120,000
合 計		3,663,205,000		3,692,325,000	29,120,000

（注）1. 株価指数先物取引の評価方法

原則として当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、当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. 「当期間」とは、当親投資信託の計算期間の開始日から本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を指しております。

（一口当たり情報に関する注記）

区 分	平成22年6月11日現在	平成23年6月13日現在
一口当たり純資産額	0.9107円	0.8806円
（一万口当たり純資産額）	(9,107円)	(8,806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22年6月11日現在	当中間計算期間末 平成23年6月13日現在
	金 額	金 額
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	3,876,765,919	3,348,158,820
未収入金	9,999,999	
流動資産合計	3,886,765,918	3,348,158,820
資産合計	3,886,765,918	3,348,158,820
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,999,999	
未払受託者報酬	1,341,313	1,214,470
未払委託者報酬	10,086,670	9,132,753
流動負債合計	21,427,982	10,347,223
負債合計	21,427,982	10,347,223
純資産の部		
元本等		
元本	4,428,592,138	3,453,955,675
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	563,254,202	116,144,078
（分配準備積立金）	747,510,117	500,594,522
元本等合計	3,865,337,936	3,337,811,597
純資産合計	3,865,337,936	3,337,811,597
負債純資産合計	3,886,765,918	3,348,158,820

(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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13日
	金 額	金 額
営業収益		
有価証券売買等損益	22,968,838	37,510,287
営業収益合計	22,968,838	37,510,287
営業費用		
受託者報酬	2,669,524	2,428,432
委託者報酬	20,074,747	18,261,720
営業費用合計	22,744,271	20,690,152
営業利益又は営業損失（ ）	224,567	16,820,135
経常利益又は経常損失（ ）	224,567	16,820,135
中間純利益又は中間純損失（ ）	224,567	16,820,135
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（ ）	53,241,422	20,577,832
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	525,329,238	134,645,490
剰余金増加額又は欠損金減少額	100,594,268	23,963,160
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	100,594,268	23,963,160
剰余金減少額又は欠損金増加額	85,502,377	1,704,051
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	85,502,377	1,704,051
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	563,254,202	116,144,078

(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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13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。	親投資信託受益証券 同左
2.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。	計算期間末日の取扱い 平成22年12月11日及び平成22年12月12日が休日のため、信託約款第41条により、前計算期間末日を平成22年12月13日としており、このため中間計算期間は182日となっております。

(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22年6月11日現在	当中間計算期間末 平成23年6月13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	4,541,442,579円 758,502,384円 871,352,825円	4,004,636,931円 169,704,055円 720,385,311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563,254,202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116,144,078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	4,428,592,138口	3,453,955,675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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	前中間計算期間末 平成22年6月11日現在	当中間計算期間末 平成23年6月13日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額		中間貸借対照表計上額は、原則として中間計算期間末日の時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項		有価証券以外の金融商品 有価証券以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		有価証券 「中間注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「1. 有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 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一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

前中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13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22年6月11日現在	当中間計算期間末 平成23年6月13日現在
一口当たり純資産額 （一万口当たり純資産額）	0.8728円 (8,728円)	0.9664円 (9,664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22年6月11日現在	平成23年6月13日現在
	金 額	金 額
資産の部		
流動資産		
預金	1,570,182,503	1,076,762,787
コール・ローン	826,943,212	226,760,777
株式	36,503,142,085	28,526,266,524
派生商品評価勘定	512,055,721	455,255,201
未収入金	490,498,329	156,185,150
未収配当金	49,654,008	41,835,442
未収利息	2,492	559
差入委託証拠金	321,107,034	136,817,657
流動資産合計	40,273,585,384	30,619,884,097
資産合計	40,273,585,384	30,619,884,097
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	491,232,359	448,415,483
未払金	480,194,022	250,191,622
未払解約金	24,527,573	493,064
その他未払費用	5,818,791	7,686,235
流動負債合計	1,001,772,745	706,786,404
負債合計	1,001,772,745	706,786,404
純資産の部		
元本等		
元本	44,674,935,640	30,389,556,649
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,403,123,001	476,458,956
元本等合計	39,271,812,639	29,913,097,693
純資産合計	39,271,812,639	29,913,097,693
負債純資産合計	40,273,585,384	30,619,884,097

（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22年6月11日及び平成23年6月13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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>有価証券 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当期末日の最終相場（外貨建証券の場合は当期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。 当期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当期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、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。 	<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 同左
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、原則として当期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、原則として当期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>

区 分	自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日	自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13日
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

（注）「当期間」とは、当親投資信託の計算期間の開始日から本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を指しております。

（貸借対照表に関する注記）

平成22年6月11日現在	平成23年6月13日現在
<p>1. 本書における開示対象ファンドの期首における</p> <p>当該親投資信託の元本額 48,606,411,680円</p> <p>期中追加設定元本額 1,994,395,106円</p> <p>期中一部解約元本額 5,925,871,146円</p> <p>元本の内訳</p> <p>ラッセル 外国株式ファンド - 2 (適格機関投資家限定) 36,484,237,568円</p> <p>ラッセル 外国株式ファンド (適格機関投資家限定) 4,409,925,969円</p> <p>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) 355,833,004円</p> <p>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) 2,500,236,550円</p> <p>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) 433,696,686円</p> <p>ラッセル グローバル・バランス・ファンド 安定型 25,312,429円</p> <p>ラッセル グローバル・バランス・ファンド 安定・成長型 254,258,756円</p> <p>ラッセル グローバル・バランス・ファンド 成長型 211,434,678円</p> <p>計 44,674,935,640円</p> <p>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5,403,123,001円であります。</p> <p>3. 本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 44,674,935,640口</p>	<p>1. 本書における開示対象ファンドの期首における</p> <p>当該親投資信託の元本額 42,651,431,419円</p> <p>期中追加設定元本額 834,174,050円</p> <p>期中一部解約元本額 13,096,048,820円</p> <p>元本の内訳</p> <p>ラッセル 外国株式ファンド - 2 (適格機関投資家限定) 22,920,815,625円</p> <p>ラッセル 外国株式ファンド (適格機関投資家限定) 3,401,563,365円</p> <p>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) 383,386,352円</p> <p>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) 2,647,782,649円</p> <p>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) 593,870,873円</p> <p>ラッセル グローバル・バランス・ファンド 安定型 24,831,568円</p> <p>ラッセル グローバル・バランス・ファンド 安定・成長型 237,771,624円</p> <p>ラッセル グローバル・バランス・ファンド 成長型 179,534,593円</p> <p>計 30,389,556,649円</p> <p>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476,458,956円であります。</p> <p>3. 本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 30,389,556,649口</p>

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成22年6月11日現在	平成23年6月13日現在
1. 貸借対照表計上額、 時価及びこれらの差 額 2. 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 3. 金融商品の時価等 に関する事項につい ての補足説明		<p>貸借対照表計上額は、原則として期末の時価で計上しているため、その差額はありません。</p> <p>有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「1. 有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」の「取引の時価等に関する事項」に記載しております。</p> <p>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一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（有価証券に関する注記）

自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日	自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13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	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

株式関連（平成23年6月13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	株価指数先物取引				
	買 建	1,126,396,795		1,113,588,166	12,808,629
合 計		1,126,396,795		1,113,588,166	12,808,629

(注) 1. 株価指数先物取引の評価方法

原則として当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、当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当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. 「当期間」とは、当親投資信託の計算期間の開始日から本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を指しております。

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	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

通貨関連（平成23年6月13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	26,936,299,502		26,647,210,189	289,089,313
	米ドル	14,459,471,760		14,258,622,868	200,848,892
	加ドル	972,810,604		960,630,574	12,180,030
	豪ドル	966,972,262		965,551,716	1,420,546
	英ポンド	1,717,921,612		1,691,492,459	26,429,153
	スイスフラン	1,336,236,303		1,373,223,660	36,987,357
	香港ドル	288,374,045		286,398,135	1,975,910
	シンガポールドル	124,878,014		123,883,336	994,678
	ニュージーランドドル	11,965,683		12,304,410	338,727
	スウェーデンクローネ	3,258,012,785		3,186,999,848	71,012,937
	ノルウェークローネ	270,964,551		268,239,719	2,724,832
	デンマーククローネ	314,809,344		312,853,037	1,956,307
	イスラエルシェケル	75,920,164		75,824,080	96,084
	ユーロ	3,137,962,375		3,131,186,347	6,776,028
	買 建	27,161,799,502		26,892,358,536	269,440,966
	米ドル	13,805,327,742		13,567,080,393	238,247,349
	加ドル	1,458,409,304		1,426,133,715	32,275,589
	豪ドル	1,249,544,083		1,264,556,422	15,012,339
	英ポンド	1,642,246,262		1,620,791,403	21,454,859
	スイスフラン	1,582,282,313		1,633,900,765	51,618,452
	香港ドル	404,367,927		397,852,019	6,515,908
	シンガポールドル	185,523,716		184,999,579	524,137
	ニュージーランドドル	15,240,222		15,705,275	465,053
	スウェーデンクローネ	3,333,763,373		3,300,819,613	32,943,760
	ノルウェークローネ	268,256,390		266,384,777	1,871,613
	デンマーククローネ	200,062,325		198,144,654	1,917,671
	イスラエルシェケル	43,644,640		43,815,477	170,837
	ユーロ	2,973,131,205		2,972,174,444	956,761
	合 計	54,098,099,004		53,539,568,725	19,648,347

（注）1. 為替予約の評価方法

(1) 当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。

当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。

当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。

- ・ 当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。
- ・ 当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) 当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、当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. 「当期間」とは、当親投資信託の計算期間の開始日から本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を指しております。

（一口当たり情報に関する注記）

区 分	平成22年6月11日現在	平成23年6月13日現在
一口当たり純資産額	0.8791円	0.9843円
（一万口当たり純資産額）	(8,791円)	(9,843円)

[前へ](#) [次へ](#)

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22年6月11日現在	当中間計算期間末 平成23年6月13日現在
	金 額	金 額
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	3,964,069,849	3,412,119,772
未収入金	5,000,000	-
流動資産合計	3,969,069,849	3,412,119,772
資産合計	3,969,069,849	3,412,119,772
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,000,000	-
未払受託者報酬	1,088,248	937,671
未払委託者報酬	4,570,594	3,938,175
流動負債合計	10,658,842	4,875,846
負債合計	10,658,842	4,875,846
純資産の部		
元本等		
元本	3,512,376,230	2,984,671,562
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	446,034,777	422,572,364
（分配準備積立金）	236,295,945	237,640,950
元本等合計	3,958,411,007	3,407,243,926
純資産合計	3,958,411,007	3,407,243,926
負債純資産合計	3,969,069,849	3,412,119,772

(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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13日
	金 額	金 額
営業収益		
有価証券売買等損益	84,713,599	57,908,607
営業収益合計	84,713,599	57,908,607
営業費用		
受託者報酬	2,172,966	1,853,633
委託者報酬	9,126,392	7,785,183
営業費用合計	11,299,358	9,638,816
営業利益又は営業損失（ ）	73,414,241	48,269,791
経常利益又は経常損失（ ）	73,414,241	48,269,791
中間純利益又は中間純損失（ ）	73,414,241	48,269,791
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（ ）	4,675,000	2,394,927
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	403,926,628	407,251,686
剰余金増加額又は欠損金減少額	25,342,542	13,086,837
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	25,342,542	13,086,837
剰余金減少額又は欠損金増加額	51,973,634	43,641,023
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	51,973,634	43,641,023
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	446,034,777	422,572,364

(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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13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.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項		計算期間末日の取扱い 平成22年12月11日及び平成22年12月12日が休日のため、信託約款第41条により、前計算期間末日を平成22年12月13日としており、このため中間計算期間は182日となっております。

(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22年6月11日現在	当中間計算期間末 平成23年6月13日現在
1.期首元本額	3,768,070,118円	3,231,722,436円
期中追加設定元本額	228,657,462円	98,913,165円
期中一部解約元本額	484,351,350円	345,964,039円
2.中間計算期間末日における受益権の総数	3,512,376,230口	2,984,671,562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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	前中間計算期間末 平成22年6月11日現在	当中間計算期間末 平成23年6月13日現在
1.中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額		中間貸借対照表計上額は、原則として中間計算期間末日の時価で計上しているため、その差額ははありません。
2.金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項		有価証券以外の金融商品 有価証券以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。 有価証券 「中間注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「1.有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		金融商品の時価には、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一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

前中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13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22年6月11日現在	当中間計算期間末 平成23年6月13日現在
一口当たり純資産額 (一万口当たり純資産額)	1.1270円 (11,270円)	1.1416円 (11,416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22年6月11日現在	平成23年6月13日現在
	金 額	金 額
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	799,436,452	593,109,230
国債証券	9,464,478,231	10,530,301,695
特殊債券	100,730,000	100,321,000
社債券	5,001,979,000	3,313,021,300
派生商品評価勘定	511,690	119,175
未収入金	304,049,000	50,023,500
未収利息	43,203,068	44,110,365
前払費用	23,024,363	16,739,025
差入委託証拠金	1,538,310	5,020,990
流動資産合計	15,738,950,114	14,652,766,280
資産合計	15,738,950,114	14,652,766,280
負債の部		
流動負債		
未払金	604,140,000	185,884,560
未払解約金	5,000,000	39,739,968
流動負債合計	609,140,000	225,624,528
負債合計	609,140,000	225,624,528
純資産の部		
元本等		
元本	12,691,860,323	11,882,209,630
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,437,949,791	2,544,932,122
元本等合計	15,129,810,114	14,427,141,752
純資産合計	15,129,810,114	14,427,141,752
負債純資産合計	15,738,950,114	14,652,766,280

（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22年6月11日及び平成23年6月13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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13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> <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当期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は当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。 当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当期間末日又は直近の日の気配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。</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。</p>	<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> <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. 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、原則として当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>

（注）「当期間」とは、当親投資信託の計算期間の開始日から本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を指しております。

（貸借対照表に関する注記）

平成22年6月11日現在		平成23年6月13日現在	
1. 本書における開示対象ファンドの期首における		1. 本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	13,251,526,293円	当該親投資信託の元本額	12,361,449,761円
期中追加設定元本額	801,626,858円	期中追加設定元本額	530,440,335円
期中一部解約元本額	1,361,292,828円	期中一部解約元本額	1,009,680,466円
元本の内訳		元本の内訳	
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）	2,810,179,355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）	2,170,554,357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）	3,025,918,911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）	3,790,896,840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	10,780,024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	51,611,400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	22,268,743円
計	12,691,860,323円	計	11,882,209,630円
2. 本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		2. 本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	12,691,860,323口	受益権の総数	11,882,209,630口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成22年6月11日現在	平成23年6月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額 2. 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 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		<p>貸借対照表計上額は、原則として期末の時価で計上しているため、その差額はありません。</p> <p>有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「1. 有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」の「取引の時価等に関する事項」に記載しております。</p> <p>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一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（有価証券に関する注記）

自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日	自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13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

債券関連（平成23年6月13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	70,340,000		70,460,000	120,000
合 計		70,340,000		70,460,000	120,000

（注）1. 債券先物取引の評価方法

原則として当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、当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. 「当期間」とは、当親投資信託の計算期間の開始日から本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を指しております。

（一口当たり情報に関する注記）

区 分	平成22年6月11日現在	平成23年6月13日現在
一口当たり純資産額	1.1921円	1.2142円
（一万口当たり純資産額）	（11,921円）	（12,142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22年6月11日現在	当中間計算期間末 平成23年6月13日現在
	金 額	金 額
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	3,372,131,177	2,876,451,499
派生商品評価勘定	36,921,786	38,928,292
未収入金	7,999,999	
流動資産合計	3,417,052,962	2,915,379,791
資産合計	3,417,052,962	2,915,379,791
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	8,588,182	605,656
未払解約金	7,999,999	
未払受託者報酬	933,353	801,386
未払委託者報酬	7,000,098	6,010,349
流動負債合計	24,521,632	7,417,391
負債合計	24,521,632	7,417,391
純資産の部		
元本等		
元本	2,730,136,758	2,305,952,946
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	662,394,572	602,009,454
(分配準備積立金)	356,047,172	379,896,410
元本等合計	3,392,531,330	2,907,962,400
純資産合計	3,392,531,330	2,907,962,400
負債純資産合計	3,417,052,962	2,915,379,791

(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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13日
	金 額	金 額
営業収益		
有価証券売買等損益	56,198,740	87,507,720
為替差損益	240,206,425	21,883,052
営業収益合計	184,007,685	65,624,668
営業費用		
受託者報酬	1,864,874	1,583,336
委託者報酬	13,986,500	11,874,952
営業費用合計	15,851,374	13,458,288
営業利益又は営業損失（ ）	168,156,311	52,166,380
経常利益又は経常損失（ ）	168,156,311	52,166,380
中間純利益又は中間純損失（ ）	168,156,311	52,166,380
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（ ）	16,251,490	1,007,979
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	557,056,772	596,883,285
剰余金増加額又は欠損金減少額	48,917,746	24,538,729
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	48,917,746	24,538,729
剰余金減少額又は欠損金増加額	95,484,767	70,570,961
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	95,484,767	70,570,961
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	662,394,572	602,009,454

(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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13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
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項		計算期間末日の取扱い 平成22年12月11日及び平成22年12月12日が休日のため、信託約款第41条により、前計算期間末日を平成22年12月13日としており、このため中間計算期間は182日となっております。

（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22年6月11日現在	当中間計算期間末 平成23年6月13日現在
1.期首元本額	2,996,318,227円	2,497,912,731円
期中追加設定元本額	247,082,261円	103,461,273円
期中一部解約元本額	513,263,730円	295,421,058円
2.中間計算期間末日における 受益権の総数	2,730,136,758口	2,305,952,946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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13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、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。	同左

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	前中間計算期間末 平成22年6月11日現在	当中間計算期間末 平成23年6月13日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額		中間貸借対照表計上額は、原則として中間計算期間末日の時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 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		有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。 有価証券 「中間注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「1. 有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 デリバティブ取引 「中間注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」の「取引の時価等に関する事項」に記載しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		金融商品の時価には、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一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

前中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13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
	英ポンド	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
	英ポンド	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

通貨関連 当中間計算期間末（平成23年6月13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	2,933,576,065		2,895,148,054	38,428,011
	米ドル	1,146,055,906		1,126,690,089	19,365,817
	加ドル	90,845,405		88,759,573	2,085,832
	豪ドル	34,610,566		33,953,447	657,119
	英ポンド	234,336,737		231,488,023	2,848,714
	スイスフラン	15,939,122		16,438,504	499,382
	シンガポールドル	28,516,052		28,124,436	391,616
	スウェーデンクローネ	29,762,053		28,981,150	780,903
	ユーロ	1,353,510,224		1,340,712,832	12,797,392
	買建	21,911,718		21,806,343	105,375
	米ドル	10,579,862		10,524,769	55,093
	加ドル	539,227		536,270	2,957
	豪ドル	209,540		206,039	3,501
	英ポンド	1,449,651		1,421,036	28,615
	スイスフラン	98,827		99,372	545
	シンガポールドル	419,690		416,703	2,987
	スウェーデンクローネ	184,060		179,533	4,527
	ユーロ	8,430,861		8,422,621	8,240
	合計	2,955,487,783		2,916,954,397	38,322,636

(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22年6月11日現在	当中間計算期間末 平成23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)	1.2426円 (12,426円)	1.2611円 (12,611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22年6月11日現在	当中間計算期間末 平成23年6月13日現在
	金　額	金　額
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	713,137,594	629,056,901
流動資産合計	713,137,594	629,056,901
資産合計	713,137,594	629,056,901
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	196,392	175,317
未払委託者報酬	1,472,883	1,314,855
流動負債合計	1,669,275	1,490,172
負債合計	1,669,275	1,490,172
純資産の部		
元本等		
元本	445,260,331	398,726,899
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（　）	266,207,988	228,839,830
（分配準備積立金）	155,452,237	132,698,765
元本等合計	711,468,319	627,566,729
純資産合計	711,468,319	627,566,729
負債純資産合計	713,137,594	629,056,901

(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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13日
	金　額	金　額
営業収益		
有価証券売買等損益	11,309,860	18,399,607
営業収益合計	11,309,860	18,399,607
営業費用		
受託者報酬	390,340	344,314
委託者報酬	2,927,469	2,582,279
営業費用合計	3,317,809	2,926,593
営業利益又は営業損失（　）	14,627,669	15,473,014
経常利益又は経常損失（　）	14,627,669	15,473,014
中間純利益又は中間純損失（　）	14,627,669	15,473,014
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（　）	233,572	1,235,310
期首剰余金又は期首欠損金（　）	286,267,858	231,403,122
剰余金増加額又は欠損金減少額	16,776,712	6,909,762
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	16,776,712	6,909,762
剰余金減少額又は欠損金増加額	21,975,341	23,710,758
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	21,975,341	23,710,758
中間剰余金又は中間欠損金（　）	266,207,988	228,839,830

(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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13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。	親投資信託受益証券 同左
2.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。	計算期間末日の取扱い 平成22年12月11日及び平成22年12月12日が休日のため、信託約款第41条により、前計算期間末日を平成22年12月13日としており、このため中間計算期間は182日となっております。

(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22年6月11日現在	当中間計算期間末 平成23年6月13日現在
1.期首元本額	453,828,125円	429,690,591円
期中追加設定元本額	26,223,291円	13,090,241円
期中一部解約元本額	34,791,085円	44,053,933円
2.中間計算期間末日における 受益権の総数	445,260,331口	398,726,899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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	前中間計算期間末 平成22年6月11日現在	当中間計算期間末 平成23年6月13日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額		中間貸借対照表計上額は、原則として中間計算期間末日の時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項		有価証券以外の金融商品 有価証券以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。 有価証券 「中間注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「1. 有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		金融商品の時価には、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一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

前中間計算期間 自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	当中間計算期間 自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13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22年6月11日現在	当中間計算期間末 平成23年6月13日現在
一口当たり純資産額 （一万口当たり純資産額）	1.5979円 (15,979円)	1.5739円 (15,739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22年6月11日現在	平成23年6月13日現在
	金 額	金 額
資産の部		
流動資産		
預金	205,238,590	321,329,523
コール・ローン	355,744,193	177,060,339
国債証券	7,303,808,065	4,974,345,780
地方債証券	220,349,283	462,987,577
特殊債券	1,649,718,326	1,531,369,158
社債券	4,064,260,019	5,478,109,089
派生商品評価勘定	310,114,370	171,812,749
未収入金	54,996,534	395,545,190
未収利息	157,840,824	148,669,880
前払費用	35,349,530	11,302,001
差入委託証拠金	189,808,325	239,329,365
流動資産合計	14,547,228,059	13,911,860,651
資産合計	14,547,228,059	13,911,860,651
負債の部		
流動負債		
ブット・オプション（売）	219,152	
派生商品評価勘定	184,373,237	147,203,880
未払金	36,665,910	377,565,577
未払解約金	13,589,531	1,967,938
その他未払費用	1,091,602	848,733
流動負債合計	235,939,432	527,586,128
負債合計	235,939,432	527,586,128
純資産の部		
元本等		
元本	7,578,750,878	7,130,970,236
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,732,537,749	6,253,304,287
元本等合計	14,311,288,627	13,384,274,523
純資産合計	14,311,288,627	13,384,274,523
負債純資産合計	14,547,228,059	13,911,860,651

（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22年6月11日及び平成23年6月13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21年12月12日 至 平成22年 6月11日	自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13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当期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は当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。 <p>当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当期間末日又は直近の日の気配相場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、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。 	<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 同左
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。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として当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。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として当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>

区 分	自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日	自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13日
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>(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、原則として当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>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。</p>	<p>(3)オプション取引 同左</p> <p>外貨建取引等の処理基準 同左</p>

（注）「当期間」とは、当親投資信託の計算期間の開始日から本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を指しております。

（貸借対照表に関する注記）

平成22年6月11日現在		平成23年6月13日現在	
1. 本書における開示対象ファンドの期首における		1. 本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	8,018,681,776円	当該親投資信託の元本額	7,490,008,453円
期中追加設定元本額	1,063,126,131円	期中追加設定元本額	685,061,819円
期中一部解約元本額	1,503,057,029円	期中一部解約元本額	1,044,100,036円
元本の内訳		元本の内訳	
ラッセル 外国債券ファンド Aコース（為替ヘッジあり）		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）	1,785,802,668円	（適格機関投資家限定）	1,532,554,478円
ラッセル 外国債券ファンド Bコース（為替ヘッジなし）		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）	377,661,174円	（適格機関投資家限定）	335,157,388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）	2,799,054,740円
ラッセル 外国債券ファンド Aコース（為替ヘッジあり）		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）	1,833,335,808円	（適格機関投資家限定）	1,628,070,375円
ラッセル 外国債券ファンド Bコース（為替ヘッジなし）		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）	427,722,409円	（適格機関投資家限定）	387,509,918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	96,226,773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	296,485,209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	55,911,355円
計	7,578,750,878円	計	7,130,970,236円
2. 本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	
	7,578,750,878口		7,130,970,236口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成22年6月11日現在	平成23年6月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額		貸借対照表計上額は、原則として期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 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		<p>有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「1. 有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。なお、市場価額がない場合には、事前に価額算出方法を確認した外部業者から入手する価額に基づく価額を合理的に算定された価額とし、同一銘柄の価額推移時系列比較を行っております。</p> <p>デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」の「取引の時価等に関する事項」に記載しております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		<p>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一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（有価証券に関する注記）

自 平成21年12月12日 至 平成22年 6月11日	自 平成22年12月14日 至 平成23年 6月13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

債券関連（平成23年6月13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	2,898,492,655	-	2,914,301,989	15,809,334
	売 建	118,208,702	-	119,241,989	1,033,287
	合 計	3,016,701,357	-	3,033,543,978	14,776,047

(注) 1. 債券先物取引

(1) 債券先物取引の評価方法

原則として当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、当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当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) 「当期間」とは、当親投資信託の計算期間の開始日から本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を指しております。

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

原則として当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) 「当期間」とは、当親投資信託の計算期間の開始日から本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を指しております。

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		時 価	評価損益
			うち１年超		
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

金利関連（平成23年6月13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	金利先物取引				
	買 建	1,529,421,801		1,531,643,154	2,221,353
合計		1,529,421,801		1,531,643,154	2,221,353

（注）１．金利先物取引の評価方法

原則として当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、当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当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．「当期間」とは、当親投資信託の計算期間の開始日から本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を指しております。

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

通貨関連（平成23年6月13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	10,171,033,243	-	10,063,970,935	107,062,308
	米ドル	4,790,084,743	-	4,743,199,203	46,885,540
	加ドル	391,708,270	-	381,732,800	9,975,470
	豪ドル	1,377,459,490	-	1,344,537,880	32,921,610
	英ポンド	138,058,830	-	137,363,850	694,980
	シンガポールドル	182,065,290	-	181,309,582	755,708
	ニュージーランドドル	916,963,100	-	944,842,280	27,879,180
	スウェーデンクローネ	76,569,440	-	75,316,160	1,253,280
	ノルウェークローネ	211,126,410	-	205,621,740	5,504,670
	メキシコペソ	171,030,000	-	165,536,900	5,493,100
	ポーランドズロチ	413,004,800	-	411,731,840	1,272,960
	ユーロ	1,502,962,870	-	1,472,778,700	30,184,170
	買 建	10,168,901,996	-	10,069,451,157	99,450,839
	米ドル	5,627,479,500	-	5,572,705,676	54,773,824
	加ドル	117,926,156	-	115,342,540	2,583,616
	豪ドル	146,252,022	-	144,143,000	2,109,022
	英ポンド	633,948,282	-	630,595,300	3,352,982
	スイスフラン	53,535,302	-	55,896,750	2,361,448
	シンガポールドル	451,186,313	-	452,104,583	918,270
	ニュージーランドドル	43,573,315	-	43,998,900	425,585
	スウェーデンクローネ	355,466,528	-	351,860,860	3,605,668
	ノルウェークローネ	236,918,299	-	237,551,940	633,641
	デンマーククローネ	139,984,888	-	140,270,550	285,662
	メキシコペソ	11,297,308	-	10,967,900	329,408
	ポーランドズロチ	90,058,554	-	93,254,698	3,196,144
	南アフリカランド	94,737,980	-	100,364,120	5,626,140
	ユーロ	2,166,537,549	-	2,120,394,340	46,143,209
	合計	20,339,935,239	-	20,133,422,092	7,611,469

（注）1. 為替予約の評価方法

(1) 当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。

当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。

当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。

- ・ 当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。
- ・ 当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) 当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、当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. 「当期間」とは、当親投資信託の計算期間の開始日から本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を指しております。

（一口当たり情報に関する注記）

区 分	平成22年6月11日現在	平成23年6月13日現在
一口当たり純資産額	1.8883円	1.8769円
（一万口当たり純資産額）	(18,883円)	(18,769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23年6月30日現在

(単位：円)

資 産 総 額	4,404,190,251
負 債 総 額	6,079,004
純資産総額 (-)	4,398,111,247
発 行 済 口 数	4,321,905,709 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23年6月30日現在

(単位：円)

資 産 総 額	4,650,899,630
負 債 総 額	12,788,135
純資産総額 (-)	4,638,111,495
発 行 済 口 数	4,727,367,566 口
1口当たり純資産価額 (/)	0.9811 (1万口当たり 9,811)

「三菱ＵＦＪ ＭＶ８０」

純資産額計算書

平成23年6月30日現在

(単位：円)

資 産 総 額	3,419,788,266
負 債 総 額	4,202,483
純資産総額 (-)	3,415,585,783
発 行 済 口 数	3,929,078,712 口
1口当たり純資産価額 (/)	0.8693 (1万口当たり 8,693)

[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）

(2011年6月30日現在)

種類	金額	単位
資産総額	9,196,389,115	円
負債総額	90,640,228	円
純資産総額（ - ）	9,105,748,887	円
発行済口数	10,803,383,957	口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8429	円

ラッセル 外国株式ファンド（適格機関投資家限定）

(2011年6月30日現在)

種類	金額	単位
資産総額	3,526,000,531	円
負債総額	1,737,544	円
純資産総額（ - ）	3,524,262,987	円
発行済口数	3,546,416,103	口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9938	円

ラッセル 日本債券ファンド（適格機関投資家限定）

(2011年6月30日現在)

種類	金額	単位
資産総額	3,362,852,387	円
負債総額	22,860,114	円
純資産総額（ - ）	3,339,992,273	円
発行済口数	2,921,692,540	口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1432	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）

(2011年6月30日現在)

種類	金額	単位
資産総額	2,886,392,688	円
負債総額	53,866,095	円
純資産総額（ - ）	2,832,526,593	円
発行済口数	2,259,907,991	口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2534	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）

(2011年6月30日現在)

種類	金額	単位
資産総額	618,696,409	円
負債総額	259,376	円
純資産総額（ - ）	618,437,033	円
発行済口数	392,357,670	口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5762	円

（参考）ラッセル 日本株式マザーファンド

(2011年6月30日現在)

種類	金額	単位
資産総額	40,660,139,149	円
負債総額	502,853,160	円
純資産総額（ - ）	40,157,285,989	円
発行済口数	43,596,636,966	口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9211	円

（参考）ラッセル 外国株式マザーファンド

(2011年6月30日現在)

種類	金額	単位
資産総額	30,172,898,736	円
負債総額	259,299,678	円
純資産総額（ - ）	29,913,599,058	円
発行済口数	29,537,624,950	口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0127	円

（参考）ラッセル 日本債券マザーファンド

(2011年6月30日現在)

種類	金額	単位
資産総額	12,483,972,939	円
負債総額	635,621,548	円
純資産総額（ - ）	11,848,351,391	円
発行済口数	9,742,022,280	口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2162	円

（参考）ラッセル 外国債券マザーファンド

(2011年6月30日現在)

種類	金額	単位
資産総額	13,767,323,887	円
負債総額	543,023,924	円
純資産総額（ - ）	13,224,299,963	円
発行済口数	7,032,782,268	口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8804	円

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額等

<訂正前>

平成22年12月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、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。

<訂正後>

平成23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12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23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23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	350	6,071,837
追加型公社債投資信託	18	428,311
単位型株式投資信託	10	50,138
単位型公社債投資信託	8	133,805
合 計	386	6,684,091

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26期事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23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25期事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）及び第26期事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第25期 (平成22年3月31日現在)		第26期 (平成23年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	2	8,675,536	2	17,056,128
有価証券	2	14,000,000	2	10,000,000
前払費用		136,193		156,230
未収入金	2	45,397	2	19,641
未収委託者報酬		4,345,110		4,517,987
未収収益	2	43,835	2	63,656
繰延税金資産		407,456		429,080
金銭の信託	2	500,000	2	30,000
その他		8,190		28,070
流動資産合計		28,161,721		32,300,796
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	333,687	1	306,543
器具備品	1	158,971	1	184,985
土地		1,205,031		1,205,031
有形固定資産合計		1,697,691		1,696,560
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		787,767		909,905
ソフトウェア仮勘定		72,475		146,761
その他		112		68
無形固定資産合計		876,178		1,072,557
投資その他の資産				
投資有価証券		11,797,311		9,405,012
関係会社株式		431,812		431,812
長期性預金	2	5,000,000	2	7,000,000
長期差入保証金	2	1,030,783	2	797,041
長期前払費用		142		52
繰延税金資産		474,632		442,254
その他		16,075		15,035
投資その他の資産合計		18,750,756		18,091,208
固定資産合計		21,324,626		20,860,326
資産合計		49,486,347		53,161,123

(単位：千円)

	第25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	51,838	47,528
未払金		
未払収益分配金	274,776	245,085
未払償還金	1,607,485	1,328,820
未払手数料	2 1,748,905	2 1,768,519
その他未払金	52,889	104,042
未払費用	2 1,034,566	2 1,240,586
未払消費税等	104,853	184,873
未払法人税等	1,727,215	2,228,870
賞与引当金	580,826	550,000
デリバティブ債務	7,536	
その他		227,518
流動負債合計	7,190,892	7,925,844
固定負債		
退職給付引当金	68,206	105,461
役員退職慰労引当金	66,197	76,024
時効後支払損引当金		196,123
固定負債合計	134,404	377,609
負債合計	7,325,296	8,303,454
(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	31,383,254	34,903,313
利益剰余金合計	38,723,843	42,243,903
株主資本合計	40,946,071	44,466,131
評価・換算差額等		
その他有価証券		
評価差額金	1,277,237	391,537
繰延ヘッジ損益	62,258	
評価・換算差額等合計	1,214,979	391,537
純資産合計	42,161,050	44,857,668
負債純資産合計	49,486,347	53,161,123

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)		第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		40,630,847		48,411,622
その他営業収益				
投資顧問料		7,619		16,400
その他		85,040		236,596
営業収益合計		40,723,506		48,664,618
営業費用				
支払手数料	2	17,208,659	2	19,778,797
広告宣伝費		579,833		696,640
公告費		7,195		7,795
調査費				
調査費		799,697		895,558
委託調査費		5,231,920		8,991,373
事務委託費		183,931		243,109
営業雑経費				
通信費		98,055		98,144
印刷費		607,867		569,763
協会費		35,983		37,616
諸会費		5,761		6,248
事務機器関連費		841,349		880,509
営業費用合計		25,600,255		32,205,558
一般管理費				
給料				
役員報酬		194,520		199,168
給料・手当		3,445,656		3,576,037
賞与引当金繰入		580,826		550,000
福利厚生費		458,092		492,032
交際費		21,080		23,412
旅費交通費		108,299		156,920
租税公課		102,967		108,850
不動産賃借料		654,768		655,939
退職給付費用		177,435		163,440
役員退職慰労引当金繰入		18,448		18,106
固定資産減価償却費		382,798		406,176
諸経費		287,163		369,603
一般管理費合計		6,432,057		6,719,689
営業利益		8,691,194		9,739,370

(単位：千円)

	第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	30,250	29,543
有価証券利息	2 29,170	2 11,040
受取利息	2 19,853	2 20,465
投資有価証券償還益	73,517	371,171
収益分配金等時効完成分	421,674	438,693
その他	8,586	8,257
営業外収益合計	583,053	879,170
営業外費用		
投資有価証券償還損	181,632	192,004
収益分配金等時効完成分支払額	10,520	
時効後支払損引当金繰入		666
事務過誤費	7,510	32,187
その他	3,626	7,757
営業外費用合計	203,289	232,615
経常利益	9,070,957	10,385,925
特別利益		
投資有価証券売却益	231,903	351,930
ゴルフ会員権売却益	10,190	
特別利益合計	242,093	351,930
特別損失		
投資有価証券売却損	129,159	127,114
過年度時効後支払損引当金繰入		204,138
固定資産除却損	1 701	1 3,431
資産除去債務会計基準の適用に伴う 影響額		37,264
その他		2,429
特別損失合計	129,860	374,378
税引前当期純利益	9,183,190	10,363,477
法人税、住民税及び事業税	3,627,233	4,027,373
法人税等調整額	118,635	25,800
法人税等合計	3,508,597	4,001,573
当期純利益	5,674,592	6,361,903

(3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23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	27,520,492	31,383,254
当期変動額		
剰余金の配当	1,811,830	2,841,844
当期純利益	5,674,592	6,361,903
当期変動額合計	3,862,761	3,520,059
当期末残高	31,383,254	34,903,313
利益剰余金合計		
前期末残高	34,861,082	38,723,843
当期変動額		
剰余金の配当	1,811,830	2,841,844
当期純利益	5,674,592	6,361,903
当期変動額合計	3,862,761	3,520,059
当期末残高	38,723,843	42,243,903
株主資本合計		
前期末残高	37,083,309	40,946,071
当期変動額		
剰余金の配当	1,811,830	2,841,844
当期純利益	5,674,592	6,361,903
当期変動額合計	3,862,761	3,520,059
当期末残高	40,946,071	44,466,131
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	621,031	1,277,237
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	1,898,269	885,699
当期変動額合計	1,898,269	885,699
当期末残高	1,277,237	391,537
繰延ヘッジ損益		
前期末残高		62,258

当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	62,258	62,258
当期変動額合計	62,258	62,258
当期末残高	62,258	
評価・換算差額等合計		
前期末残高	621,031	1,214,979
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	1,836,011	823,441
当期変動額合計	1,836,011	823,441
当期末残高	1,214,979	391,537
純資産合計		
前期末残高	36,462,278	42,161,050
当期変動額		
剰余金の配当	1,811,830	2,841,844
当期純利益	5,674,592	6,361,903
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	1,836,011	823,441
当期変動額合計	5,698,772	2,696,617
当期末残高	42,161,050	44,857,668

重要な会計方針

項目	第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23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
(4) 時効後支払損引当金	-	時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。
6. 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25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23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。	当事業年度より、「資産除去債務に関する会計基準」（企業会計基準第18号 平成20年3月31日）及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日）を適用しております。 これにより、営業利益、経常利益はそれぞれ12,085千円、税引前当期純利益は49,350千円減少しております。

追加情報

第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
-	従来は時効が成立し、利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者から支払請求を受けた時点で支払予定額を費用計上しておりましたが、信頼性のある見積もりを行うための社内体制を整備し、当事業年度より将来の支払見込額を合理的に見積もることが可能となりました。そのため、当事業年度より受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を「時効後支払損引当金」として計上しております。 この結果、従来の方法に比べて経常利益は8,014千円多く計上され、税引前当期純利益は196,123千円少なく計上されています。

注記事項

（貸借対照表関係）

項目	第25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23年3月31日現在)
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物 152,240千円 器具備品 167,633千円	建物 181,085千円 器具備品 227,109千円
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 5,272,377千円 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	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 13,335,700千円 有価証券 10,000,000千円 未収入金 1,500千円 未収収益 63,656千円 金銭の信託 30,000千円 長期性預金 7,000,000千円 長期差入保証金 788,590千円 未払手数料 986,786千円 未払費用 134,713千円

（損益計算書関係）

項目	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
1.固定資産除却損の内訳	器具備品 701千円	器具備品 3,431千円
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 11,148,518千円 有価証券利息 26,197千円 受取利息 19,853千円	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 11,685,424千円 有価証券利息 8,718千円 受取利息 20,465千円

（株主資本等変動計算書関係）

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

第26期（自 平成22年4月1日 至 平成23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
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

(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23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	3,189,318千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	25,700円
基準日	平成23年3月31日
効力発生日	平成23年6月30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。

第26期（自 平成22年4月1日 至 平成23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。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

（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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成23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	17,056,128	17,056,128	-
(2) 有価証券	10,000,000	10,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	4,517,987	4,517,987	-
(4) 長期性預金	7,000,000	7,010,576	10,576
(5) 投資有価証券	9,140,755	9,140,755	-
(6) 未払手数料	(1,768,519)	(1,768,519)	-
(7) 未払法人税等	(2,228,870)	(2,228,870)	-

(*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。

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

（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、基準価額によっております。

（6）未払手数料及び（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。

（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	17,056,128	-	-	-
未収委託者報酬	4,517,987	-	-	-
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	10,000,000	-	-	-
投資信託	-	2,032,211	1,152,101	-
長期性預金	-	7,000,000	-	-
合計	31,574,115	9,032,211	1,152,101	-

（有価証券関係）

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

第26期（平成23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	4,026,733	3,476,499	550,234
	小 計	4,026,733	3,476,499	550,234
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	5,114,022	5,236,164	122,142
	小 計	5,114,022	5,236,164	122,142
	合 計	9,140,755	8,712,663	428,091

(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22年4月1日 至 平成23年3月31日)

種類	売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他	4,283,999	392,809	127,114
合 計	4,283,999	392,809	127,114

(デリバティブ取引関係)

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。

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

重要な取引はありません。

(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25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23年3月31日現在)
(1)退職給付債務	661,846	567,377
(2)年金資産	416,582	309,065
(3)未積立退職給付債務 (1)+(2)	245,263	258,311
(4)未認識数理計算上の差異	177,056	152,850
(5)貸借対照表計上額純額 (3)+(4)	68,206	105,461
(6)退職給付引当金	68,206	105,461

3.退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

	第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
(1)勤務費用	28,685	28,585
(2)利息費用	11,367	9,774
(3)期待運用収益	6,824	6,248
(4)数理計算上の差異の費用処理額	57,581	37,969
(5)退職給付費用	90,809	70,080
(6)その他	86,626	93,360
(7)合計	177,435	163,440

(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25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23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。	同左

(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的主要原因別の内訳

(単位：千円)

	第25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	669,724	651,260
投資有価証券評価損	849,883	408,754
ゴルフ会員権評価損	9,710	9,710
未払事業税	136,281	172,269
賞与引当金	236,338	223,795
役員退職慰労引当金	26,935	30,934
退職給付引当金	27,753	42,912
減価償却超過額	54,520	39,127
委託者報酬	106,666	92,577
長期差入保証金	-	20,080
時効後支払損引当金	-	79,802
その他	62,287	34,708
繰延税金資産 小計	2,180,101	1,805,934
評価性引当額	1,298,012	898,045
繰延税金資産 合計	882,088	907,888
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	36,553
繰延税金負債 合計	-	36,553
繰延税金資産(負債)の純額	882,088	871,334

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25期 (平成22年3月31日現在)		第26期 (平成23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認容	2.1	投資有価証券評価損認容	2.9
その他	0.4	その他	0.8
税効果会計適用後の法人税等の負担率	38.2	税効果会計適用後の法人税等の負担率	38.6

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第26期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第26期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

第26期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第26期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第26期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

(追加情報)

第26期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

当事業年度より、「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（企業会計基準第17号 平成21年3月27日）及び「セグメント情報等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20号 平成20年3月21日）を適用しております。

(関連当事者情報)

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
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	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	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）

第26期（自 平成22年4月1日 至 平成23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
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	4,481,369 千円	未払手数料	294,093 千円
							事務所の賃借	631,409 千円	長期差入保証金	783,794 千円
							投資の助言	189,915 千円	未払費用	88,454 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	7,204,055 千円	未払手数料	692,693 千円
							取引銀行	41,000,000 千円	有価証券	10,000,000 千円
							譲渡性預金に係る受取利息	8,718 千円	未収利息	675 千円
							マルチコーラブル預金の預入	9,000,000 千円	現金及び預金	6,000,000 千円
									長期性預金	7,000,000 千円
							マルチコーラブル預金に係る受取利息	18,499 千円	未収利息	3,069 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 モルガン・スタンレー証券(株)	東京都千代田区	3,000 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	4,447,569 千円	未払手数料	408,084 千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券(株)は、平成22年5月1日付で三菱ＵＦＪ証券(株)から商号変更をしております。

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25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
1株当たり純資産額	339,739円97銭	361,469円71銭
1株当たり当期純利益	45,726円70銭	51,265円16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、記載していません。

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25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
当期純利益（千円）	5,674,592	6,361,903
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）	5,674,592	6,361,903
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22年9月末現在）

（略）

<訂正後>

（略）

資本金の額：324,279百万円（平成23年3月末現在）

（略）

（２）販売会社

<更新後>

名称	資本金の額 (平成23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	18,000 百万円 (平成23年6月27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12月末現在）

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社は委託会社の株式の30.0%（37,230株）、株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行は15.0%（18,615株）を所有しています。

（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23年6月末現在）

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社は委託会社の株式の50.0%（62,050株）、株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行は25.0%（31,023株）を所有しています。

（略）

独立監査人の中間監査報告書

平成23年 7月26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22年12月14日から平成23年 6月13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 ＭＶ２０の平成23年 6月13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22年12月14日から平成23年 6月13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23年 7 月26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22年12月14日から平成23年 6 月13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 ＭＶ４０の平成23年 6 月13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22年12月14日から平成23年 6 月13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23年 7月26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22年12月14日から平成23年 6月13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23年 6月13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22年12月14日から平成23年 6月13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２３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	山田 信之	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２２年４月１日から平成２３年３月３１日までの第２６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２３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 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 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](#)