

【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24年9月11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24年3月9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】**

<訂正前>

(略)

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

(略)

<訂正後>

(略)

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

(略)

[ファンドの目的・特色]

<更新後>

ファンドの目的

内外の株式および公社債を実質的な主要投資対象とし、「資産区分の分散(マルチ・アセット)」に加え「運用スタイルの分散(マルチ・スタイル)」、「運用会社の分散(マルチ・マネージャー)」を行うことにより、各資産の指数を合成したベンチマークを中長期的に上回る投資成果をめざします。

ファンドの特色

- 1 三菱UFJ MVは投資信託証券を主要投資対象とするファンド・オブ・ファンズ(F.O.F)です。株式や公社債等に直接投資するのではなく、複数の投資信託証券に投資することにより、同時に複数の投資信託を購入したことと同じ効果が得られます。



三菱UFJ MV20、三菱UFJ MV40、三菱UFJ MV80を総称して「三菱UFJ MV」といいます。

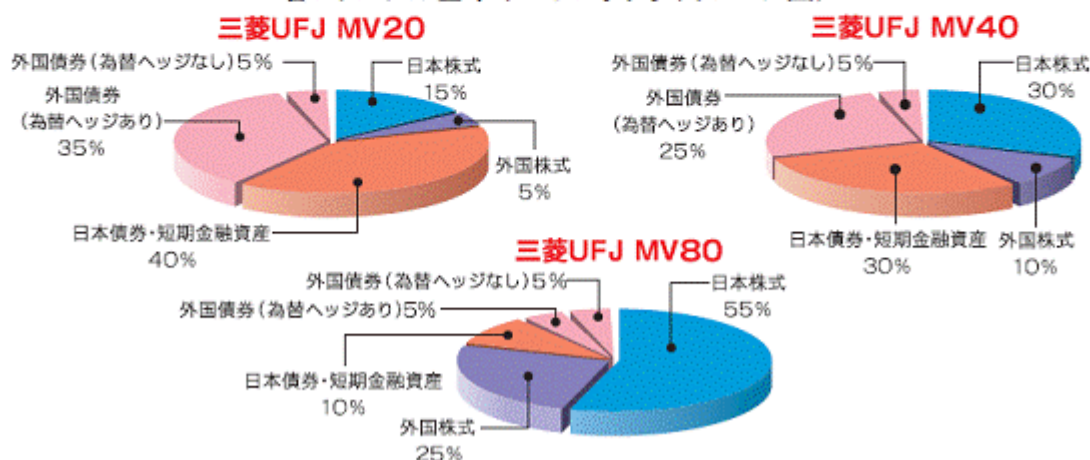
- 2 投資信託証券は、内外の株式および公社債(これらを投資対象とするマザーファンドを含みます。)を主要投資対象とします。

リスクの異なる3種類のファンドをご用意いたしました。投資者のみなさまの年齢やライフスタイル等に合せてご自由にお選び頂けます。

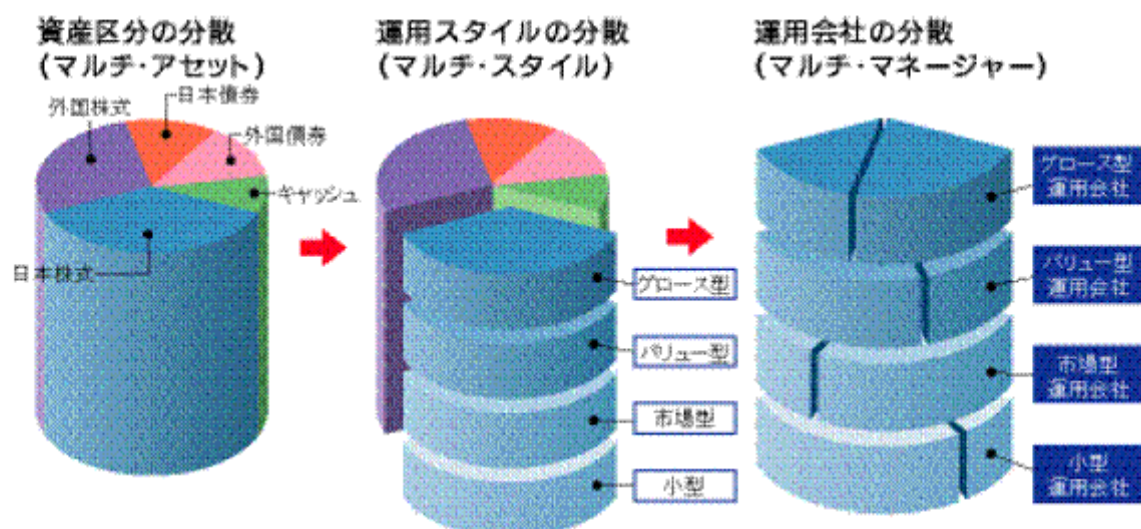
また、三菱UFJ MVの各ファンド間ではスイッチング(乗換え)が無手数料で行えます。

- 1 スwitchingの際は、換金するファンドに対して信託財産留保額および税金がかかります。

各ファンドの基準ポートフォリオ(イメージ図)



- 3** 主要投資対象である投資信託証券は、ラッセル・インベストメント株式会社（以下、「ラッセル」といいます。）が設定・運用を行います。各ファンドは投資信託証券への投資を通じての「資産区分の分散（マルチ・アセット）」に加え、投資信託証券はマザーファンドへの投資を通じて、「運用スタイルの分散（マルチ・スタイル）」、「運用会社の分散（マルチ・マネージャー）」の運用アプローチを採用し、収益の安定化をめざします。株式の場合には、グロース（成長）型、バリュウ（割安）型、マーケット・オリエンテッド型などに代表される複数の運用スタイルを組み合わせることで運用されます。



1 上記はイメージ図であり、実際のファンドの内容とは異なることがあります。

1 運用会社については、事前の告知なく変更となる場合がありますので、販売会社にお問合せください。

- **グロース（成長）型:** 主としてファンダメンタル・リサーチに基づき株価にまだ反映されていない成長株を見つけ出し投資する運用スタイルです。
- **バリュウ（割安）型:** PER（株価収益率）、PBR（株価純資産倍率）、利回りなどの尺度を用いて割安株を見つけ出し投資する運用スタイルです。
- **マーケット・オリエンテッド型:** 特定の傾向を持つ株式のみに焦点を当てるのではなく、幅広い株式に投資する運用スタイルです。

ラッセル・インベストメント グループとは

ラッセルはグローバルに総合的な資産運用・管理サービスを提供するラッセル・インベストメント グループの一員です。ラッセル・インベストメント グループは1936年米国にてフランク・ラッセル・カンパニーを創業して以来、資産運用コンサルティング分野において年金基金等大規模投資家に対して資産運用に関するアドバイスを行っており、資産運用サービス分野においても大規模投資家から個人投資家に至るまで幅広い投資家の皆様に「マルチ・マネージャー・ファンド」を提供しています。運用会社の選定にあたっては運用プロダクトを評価しているラッセル・インベストメント グループの資産運用コンサルティングで培った運用会社調査能力（定性評価および定量評価の能力）を活かし、世界中の優れた運用会社から外部委託先の運用会社を選定します。

4 運用にあたっては、下記の各指数をそれぞれの基準ポートフォリオの比率で組み合わせた指数を合成ベンチマークとし、中長期的に当該指数を上回る投資成果をめざします。


<合成ベンチマーク>

	日本株式	外国株式	日本債券・ 短期金融資産	外国債券 (為替ヘッジあり)	外国債券 (為替ヘッジなし)
	配当込みTOPIX	MSCIコクサイ インデックス (除く日本 円換算ベース)	NOMURA-BPI 総合指数 (短期金融資産 (有担保コール 翌日物)1%を含む)	シティグループ 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・ 円ベース)	シティグループ 世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
三菱UFJ MV20	15%	5%	40%	35%	5%
三菱UFJ MV40	30%	10%	30%	25%	5%
三菱UFJ MV80	55%	25%	10%	5%	5%

各合成ベンチマークの計算にあたっては、委託会社において、ファンドにおける組入資産・為替の評価時点にあわせて計算を行います。

指数について

- ・配当込みTOPIXとは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数(TOPIX)に、現金配当による権利落ちの修正を加えた株価指数です。配当込みTOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、配当込みTOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、配当込みTOPIXの算出もしくは公表の停止または配当込みTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
- ・MSCIコクサイ インデックスとは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要国で構成されています。MSCIコクサイ インデックス(除く日本 円換算ベース)は、MSCIコクサイ インデックス(除く日本 米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。また、MSCIコクサイ インデックスはMSCI Inc.の財産であり、「MSCI」はMSCI Inc.のサービスマークです。
- ・NOMURA-BPI総合指数とは、野村証券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI総合指数は野村証券株式会社の知的財産であり、各ファンドの運用成果に関し、野村証券株式会社は一切関係ありません。
- ・シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)ならびにシティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)とは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し指数化した債券インデックスです。

 ベンチマークとは、ファンドの運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指標です。

主な投資制限

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

分配方針

- 年1回の決算時(12月12日(休業日の場合は翌営業日))に分配を行います。
- 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。
- 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)

(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23年12月末現在）
（略）
- ・大株主の状況（平成23年12月末現在）
（略）

< 訂正後 >

- ・資本金
2,000百万円（平成24年6月末現在）
（略）
- ・大株主の状況（平成24年6月末現在）
（略）

2 【投資方針】

(2) 【投資対象】

< 投資信託証券の概要 >

< 更新後 >

(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24年7月31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	三井住友信託銀行株式会社（日本）
（略）	（略）

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24年7月31日現在）

委託内容	運用会社
（略）	（略）
外国株式を対象としたグロース （成長）型の運用	サステナブル・グロース・アドバイザーズ・エル・ピー（米国）
	マッキンリー・キャピタル・マネジメント・エル・エル・シー（米国）
（略）	（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24年7月31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24年7月31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24年3月10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24年9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。

3【投資リスク】

(2) 投資リスクに対する管理体制

〔投資信託証券の設定・運用を行うラッセルの投資リスクに関する管理体制〕

< 訂正前 >

（略）

ファンド全体での管理は、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。

（略）

< 訂正後 >

（略）

ファンド全体での管理は、法務・コンプライアンス部が法令・信託約款の遵守状況等のモニタリングを通じて行っています。また、法務・コンプライアンス部は定期的に運用会社から法令遵守状況の確認をとっています。

（略）

4【手数料等及び税金】

(5) 【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

（略）

上記は平成23年12月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

（略）

< 訂正後 >

（略）

上記は平成24年6月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

（略）

5【運用状況】

<更新後>

「三菱UFJ MV20」

(1)【投資状況】

平成24年6月29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	3,859,206,691	99.18
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		31,819,435	0.82
純資産総額		3,891,026,126	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24年6月29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		1,288,923,755	1.1575 1.1725	1,492,015,050 1,511,263,102		38.84
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		991,972,208	1.3059 1.3690	1,295,511,018 1,358,009,952		34.90
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		795,281,630	0.7397 0.7507	588,316,743 597,017,919		15.34
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		223,077,906	0.8641 0.8878	192,765,405 198,048,564		5.09
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		122,689,136	1.5234 1.5883	186,911,630 194,867,154		5.01

(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24年6月29日現在

種類/業種別	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.18
合計	99.18

(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24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2計算期間末日 (平成14年12月12日)	25,053,285,644 (分配付)	9,744 (分配付)
	25,053,285,644 (分配落)	9,744 (分配落)
第3計算期間末日 (平成15年12月12日)	22,573,147,925 (分配付)	10,091 (分配付)
	22,380,772,012 (分配落)	10,005 (分配落)
第4計算期間末日 (平成16年12月13日)	19,397,039,013 (分配付)	10,479 (分配付)
	18,749,155,611 (分配落)	10,129 (分配落)
第5計算期間末日 (平成17年12月12日)	11,739,247,647 (分配付)	10,907 (分配付)
	11,416,361,985 (分配落)	10,607 (分配落)
第6計算期間末日 (平成18年12月12日)	9,178,061,823 (分配付)	10,631 (分配付)
	9,178,061,823 (分配落)	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)
第11計算期間末日 (平成23年12月12日)	4,097,873,356 (分配付) 4,097,873,356 (分配落)	10,069 (分配付) 10,069 (分配落)
平成23年 6月末日	4,398,111,247	10,176
7月末日	4,304,751,485	10,227
8月末日	4,211,922,418	10,101
9月末日	4,179,359,942	10,100
10月末日	4,177,901,333	10,151
11月末日	4,069,759,523	9,988
12月末日	4,066,590,930	10,089
平成24年 1月末日	4,094,129,571	10,223
2月末日	4,110,748,785	10,486
3月末日	4,026,614,804	10,546
4月末日	3,995,817,276	10,475
5月末日	3,884,458,063	10,257
6月末日	3,891,026,126	10,345

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第2計算期間	0円
第3計算期間	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
第11計算期間	0円

【収益率の推移】

	収益率(%)
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11計算期間	0.57
第11計算期間末日から 平成24年6月末日までの期間	2.74

(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11計算期間末日から平成24年6月末日までの期間については平成24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	172,353,277	885,727,555	4,069,865,887
第12計算期間期首から 平成24年6月29日までの期間	75,157,618	383,930,705	3,761,092,800

「三菱UFJ MV40」

(1) 投資状況

平成24年6月29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	4,059,384,689	98.99
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		41,234,517	1.01
純資産総額		4,100,619,206	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24年6月29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		1,669,772,640	0.7398 0.7507	1,235,458,097 1,253,498,320		30.57
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		1,006,490,745	1.1576 1.1725	1,165,161,997 1,180,110,398		28.78
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		743,244,776	1.3067 1.3690	971,216,529 1,017,502,098		24.81
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		460,454,546	0.8621 0.8878	396,987,790 408,791,545		9.97
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		125,594,868	1.5218 1.5883	191,130,270 199,482,328		4.86

(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24年6月29日現在

種類/業種別	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.99
合計	98.99

(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24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)
第11計算期間末日 (平成23年12月12日)	4,184,402,376 (分配付) 4,184,402,376 (分配落)	9,416 (分配付) 9,416 (分配落)
平成23年 6月末日	4,638,111,495	9,811
7月末日	4,573,707,842	9,834
8月末日	4,396,047,843	9,493
9月末日	4,296,004,389	9,453
10月末日	4,310,884,886	9,583
11月末日	4,155,479,402	9,314
12月末日	4,158,117,279	9,383
平成24年 1月末日	4,220,781,611	9,568
2月末日	4,391,647,943	10,017
3月末日	4,397,922,900	10,140
4月末日	4,271,791,198	9,963
5月末日	4,047,034,666	9,515
6月末日	4,100,619,206	9,660

分配の推移

	1万口当たりの分配金
第2計算期間	0円
第3計算期間	0円
第4計算期間	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
第11計算期間	0円

収益率の推移

	収益率(%)
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11計算期間	4.08
第11計算期間末日から 平成24年6月末日までの期間	2.59

（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11計算期間末日から平成24年6月末日までの期間については平成24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	181,829,685	859,747,486	4,443,783,958
第12計算期間期首から 平成24年6月29日までの期間	88,489,560	287,343,153	4,244,930,365

「三菱UFJ MV80」

（１）投資状況

平成24年6月29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	3,006,462,995	99.14
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		25,972,649	0.86
純資産総額		3,032,435,644	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24年6月29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		2,247,365,118	0.7408 0.7507	1,664,982,921 1,687,096,994		55.64
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		847,870,700	0.8598 0.8878	729,048,086 752,739,607		24.82
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		228,226,349	1.1579 1.1725	264,269,451 267,595,394		8.82
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		94,217,895	1.5224 1.5883	143,442,882 149,646,282		4.93
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		109,119,590	1.3102 1.3690	142,973,833 149,384,718		4.93

（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24年6月29日現在

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

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

下記計算期間末日および平成24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)
第11計算期間末日 (平成23年12月12日)	3,029,393,351 (分配付) 3,029,393,351 (分配落)	7,816 (分配付) 7,816 (分配落)
平成23年 6月末日	3,415,585,783	8,693
7月末日	3,382,365,226	8,642
8月末日	3,107,798,453	7,940
9月末日	3,055,751,917	7,816
10月末日	3,169,299,112	8,104
11月末日	2,982,225,036	7,680
12月末日	2,985,224,446	7,705
平成24年 1月末日	3,063,999,165	7,953
2月末日	3,323,659,207	8,681
3月末日	3,387,620,974	8,904
4月末日	3,265,189,128	8,570
5月末日	2,959,189,097	7,772
6月末日	3,032,435,644	7,979

分配の推移

	1万口当たりの分配金
第2計算期間	0円
第3計算期間	0円
第4計算期間	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
第11計算期間	0円

収益率の推移

	収益率（％）
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11計算期間	10.94
第11計算期間末日から 平成24年6月末日までの期間	2.08

（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11計算期間末日から平成24年6月末日までの期間については平成24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	307,933,430	516,000,942	3,875,933,842
第12計算期間期首から 平成24年6月29日までの期間	140,533,911	215,939,174	3,800,528,579

[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

(2012年6月29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	8,027,579,856	100.05
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	4,293,538	0.05
合計（純資産総額）	-	8,023,286,318	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

(2012年6月29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	3,034,413,698	100.06
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	1,671,173	0.06
合計（純資産総額）	-	3,032,742,525	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

(2012年6月29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	2,956,699,995	100.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	792,844	0.03
合計（純資産総額）	-	2,955,907,151	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

(2012年6月29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	2,510,464,988	99.43
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	14,514,011	0.57
合計（純資産総額）	-	2,524,978,999	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

(2012年6月29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	544,250,225	100.04
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	240,134	0.04
合計（純資産総額）	-	544,010,091	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

(2012年6月29日現在)

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	32,905,298,220	93.23
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,390,519,824	6.77
合計(純資産総額)	-	35,295,818,044	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

(2012年6月29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	2,406,970,000	6.82

(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

(2012年6月29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	12,851,800,646	44.61
	カナダ	181,196,317	0.63
	ドイツ	1,895,635,084	6.58
	イタリア	282,945,614	0.98
	フランス	1,880,703,601	6.53
	オーストラリア	302,562,114	1.05
	イギリス	1,672,117,473	5.80
	スイス	2,601,866,946	9.03
	パミューダ	57,514,482	0.20
	香港	48,464,057	0.17
	オランダ	844,877,322	2.93
	スペイン	372,331,224	1.29
	ベルギー	324,896,889	1.13
	スウェーデン	337,643,614	1.17
	ノルウェー	82,444,703	0.29
	オーストリア	75,841,487	0.26
	タイ	43,805,976	0.15
	フィンランド	88,441,717	0.31
	デンマーク	292,812,649	1.02
	インドネシア	17,431,475	0.06
	メキシコ	159,244,581	0.55
	ブラジル	373,625,244	1.30
	韓国	94,549,070	0.33
	アイルランド	172,576,133	0.60
	ギリシャ	11,943,825	0.04
	インド	34,988,230	0.12
	チェコ	33,684,453	0.12
	イスラエル	44,226,598	0.15
	南アフリカ	38,100,567	0.13
	中国	106,297,698	0.37
	ケイマン島	104,237,291	0.36
	パナマ	203,369,874	0.71
キュラソー	184,348,417	0.64	

	ジャージー	305,083,565	1.06
	英ヴァージン諸島	163,987,653	0.57
	小計	26,285,596,589	91.23
投資証券	アメリカ	47,403,428	0.16
	フランス	16,541,570	0.06
	小計	63,944,998	0.22
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,462,326,422	8.55
合計(純資産総額)	-	28,811,868,009	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

(2012年6月29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	1,274,286,459	4.42
		カナダ	110,169,556	0.38
		ドイツ	295,084,490	1.02
		オーストラリア	80,048,250	0.28
		イギリス	227,952,986	0.79
		スイス	83,504,807	0.29
		香港	48,545,000	0.17

(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

(2012年6月29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	394,275,000	3.34
国債証券	日本	8,523,754,760	72.31
社債券	日本	2,329,338,000	19.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	540,923,392	4.59
合計(純資産総額)	-	11,788,291,152	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

(2012年6月29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	57,560,000	0.49

(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

(2012年6月29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	879,524,546	7.37
	ドイツ	163,550,882	1.37
	イタリア	1,070,735,553	8.98
	フランス	782,465,278	6.56
	オーストラリア	23,953,375	0.20
	イギリス	688,026,322	5.77
	マレーシア	21,358,251	0.18
	ニュージーランド	534,002,351	4.48
	オランダ	75,126,505	0.63
	スペイン	136,786,830	1.15
	ベルギー	41,865,760	0.35
	オーストリア	296,694,741	2.49
	メキシコ	318,595,032	2.67
	ブラジル	50,108,058	0.42
	韓国	5,112,782	0.04
	アイルランド	338,641,738	2.84
	チェコ	72,639,840	0.61
	ポーランド	339,412,696	2.85
	南アフリカ	327,343,179	2.74
	スロバキア	11,652,109	0.10
スロベニア	43,527,060	0.36	
	小計	6,221,122,888	52.16
地方債証券	アメリカ	516,919,254	4.33
	カナダ	134,910,041	1.13
	小計	651,829,295	5.47
特殊債券	日本	192,284,640	1.61
	アメリカ	1,410,844,117	11.83
	ドイツ	369,722,942	3.10
	オーストラリア	78,083,387	0.65
	オランダ	39,746,603	0.33
	スペイン	200,001,324	1.68
	韓国	43,269,553	0.36
	アイルランド	25,178,040	0.21
	国際機関	551,935,125	4.63
	小計	2,911,065,731	24.41
社債券	アメリカ	808,758,943	6.78
	フランス	348,582,640	2.92
	オーストラリア	192,577,401	1.61
	イギリス	703,187,086	5.90
	スイス	48,754,236	0.41
	ニュージーランド	31,055,793	0.26
	オランダ	232,598,986	1.95
	スウェーデン	73,354,933	0.62
	ノルウェー	30,925,960	0.26
	ルクセンブルク	42,502,339	0.36
	アイルランド	50,818,614	0.43
	小計	2,563,116,931	21.49
	売付債券	アメリカ	250,495,083
小計		250,495,083	2.1

現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	420,077,224	1.42
合計(純資産総額)	-	11,927,057,621	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

(2012年6月29日現在)

資産の種類	買建/売建	地域	評価額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	買建	アメリカ	562,931,248	4.72
		ドイツ	865,826,375	7.26
	売建	カナダ	53,428,081	0.45
		ドイツ	672,840,032	5.64
		オーストラリア	651,918,580	5.47
		イギリス	88,675,948	0.74

(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）

(2012年6月29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	9,535,075,254	0.8224	7,841,645,889	0.8419	8,027,579,856	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

(2012年6月29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）

(2012年6月29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	3,315,936,727	0.8839	2,930,956,473	0.9151	3,034,413,698	100.06

(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

(2012年6月29日現在)

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

(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）

(2012年6月29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	2,359,885,063	1.2343	2,912,885,466	1.2529	2,956,699,995	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

(2012年6月29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）

(2012年6月29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	1,313,210,749	1.8367	2,412,098,019	1.9117	2,510,464,988	99.43
----	---------------	----------------------	---------------	--------	---------------	--------	---------------	-------

(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

(2012年6月29日現在)

国内 / 外国	種類	投資比率 (%)
国内	親投資信託受益証券	99.43
	合計	99.43

(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)

(2012年6月29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	284,694,369	1.8238	519,225,591	1.9117	544,250,225	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

(2012年6月29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

(2012年6月29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	3,711,900	392.13	1,455,582,720	378.00	1,403,098,200	3.98
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	309,800	3,314.40	1,026,801,847	3,190.00	988,262,000	2.80
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	329,600	2,675.07	881,704,076	2,612.00	860,915,200	2.44
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	223,700	3,660.03	818,749,743	3,700.00	827,690,000	2.35
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	851,700	830.28	707,154,937	748.00	637,071,600	1.80
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	4,723	136,494.36	644,662,862	132,700.00	626,742,100	1.78
日本	株式	オリックス	その他金融業	79,270	7,456.70	591,093,194	7,370.00	584,219,900	1.66
日本	株式	三菱商事	卸売業	361,600	1,803.08	651,993,728	1,596.00	577,113,600	1.64
日本	株式	三井物産	卸売業	489,000	1,287.97	629,820,984	1,174.00	574,086,000	1.63
日本	株式	日立製作所	電気機器	949,000	513.64	487,444,360	487.00	462,163,000	1.31
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	165,800	2,889.24	479,037,284	2,749.00	455,784,200	1.29
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	89,500	5,078.70	454,543,962	5,000.00	447,500,000	1.27
日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	450,700	1,092.36	492,330,971	983.00	443,038,100	1.26
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	3,089,300	128.45	396,840,387	134.00	413,966,200	1.17
日本	株式	三井不動産	不動産業	247,000	1,498.87	370,220,976	1,530.00	377,910,000	1.07
日本	株式	住友商事	卸売業	331,400	1,156.18	383,158,141	1,108.00	367,191,200	1.04
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	133,100	2,409.32	320,680,492	2,397.00	319,040,700	0.90
日本	株式	三菱電機	電気機器	468,000	695.47	325,481,999	660.00	308,880,000	0.88
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	89,100	3,269.98	291,355,402	3,465.00	308,731,500	0.87
日本	株式	キヤノン	電気機器	96,900	3,776.42	365,935,098	3,165.00	306,688,500	0.87
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	126,600	2,341.88	296,482,855	2,361.00	298,902,600	0.85
日本	株式	ソニー	電気機器	235,200	1,262.19	296,868,356	1,123.00	264,129,600	0.75
日本	株式	小松製作所	機械	139,600	2,349.54	327,997,000	1,878.00	262,168,800	0.74
日本	株式	東芝	電気機器	858,000	339.97	291,694,260	300.00	257,400,000	0.73
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	140,000	1,853.78	259,529,211	1,815.00	254,100,000	0.72
日本	株式	大塚ホールディングス	医薬品	102,900	2,372.64	244,144,656	2,443.00	251,384,700	0.71
日本	株式	豊田通商	卸売業	162,800	1,565.71	254,898,476	1,511.00	245,990,800	0.70
日本	株式	ファナック	電気機器	18,100	14,935.79	270,337,800	12,950.00	234,395,000	0.66
日本	株式	丸紅	卸売業	431,000	553.95	238,756,590	526.00	226,706,000	0.64

日本	株式	積水ハウス	建設業	295,000	744.45	219,614,994	748.00	220,660,000	0.63
----	----	-------	-----	---------	--------	-------------	--------	-------------	------

(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

(2012年6月29日現在)

国内/外国	種類	業種	投資比率(%)
国内	株式	鉱業	0.46
		建設業	2.44
		食料品	1.85
		繊維製品	0.78
		パルプ・紙	0.19
		化学	6.08
		医薬品	3.10
		石油・石炭製品	1.42
		ゴム製品	1.27
		ガラス・土石製品	1.80
		鉄鋼	1.27
		非鉄金属	1.94
		金属製品	1.33
		機械	3.63
		電気機器	10.57
		輸送用機器	8.85
		精密機器	0.35
		その他製品	1.37
		電気・ガス業	1.40
		陸運業	2.68
		海運業	0.57
		空運業	0.07
		倉庫・運輸関連業	0.21
		情報・通信業	7.72
		卸売業	7.62
		小売業	4.88
		銀行業	11.10
証券、商品先物取引業	0.95		
保険業	0.95		
その他金融業	2.78		
不動産業	2.23		
サービス業	1.37		
	合計		93.23

(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

(2012年6月29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	123,956	4,642.39	575,453,173	4,599.64	570,154,153	1.98
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	55,576	9,545.75	530,514,724	9,637.75	535,627,660	1.86
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	9,879	48,355.30	477,702,077	45,131.35	445,852,660	1.55
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	185,900	2,257.95	419,753,964	2,048.57	380,830,520	1.32
イギリス	株式	DIAGEO PLC	食品・飲料・タバコ	189,918	1,932.98	367,108,455	1,999.46	379,735,115	1.32
ドイツ	株式	LINDE AG	素材	30,399	12,549.25	381,484,892	11,572.32	351,787,198	1.22
アメリカ	株式	STARWOOD HOTELS & RESORTS	消費者サービス	85,000	4,390.89	373,226,256	3,989.29	339,089,905	1.18

アメリカ	株式	NATIONAL OILWELL VARCO INC	エネルギー	67,596	5,936.05	401,253,843	4,928.32	333,134,948	1.16
フランス	株式	DANONE	食品・飲料・タバコ	69,836	5,164.55	360,671,901	4,675.33	326,506,974	1.13
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	42,857	6,928.20	296,922,172	6,790.52	291,021,409	1.01
アメリカ	株式	STATE STREET CORP	各種金融	83,467	3,395.98	283,452,454	3,423.81	285,775,374	0.99
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	102,590	2,646.24	271,478,301	2,575.98	264,270,690	0.92
オランダ	株式	AKZO NOBEL	素材	76,056	4,343.19	330,326,001	3,471.69	264,043,493	0.92
ベルギー	株式	ANHEUSER-BUSCH INBEV SPN ADR	食品・飲料・タバコ	43,445	5,500.14	238,953,951	5,852.28	254,252,517	0.88
スイス	株式	ADECCO SA-REG	商業・専門サービス	73,290	3,567.28	261,446,353	3,350.05	245,525,714	0.85
スイス	株式	JULIUS BAER GROUP LTD	各種金融	86,607	2,958.13	256,195,537	2,745.81	237,806,713	0.83
フランス	株式	BNP PARIBAS	銀行	83,503	2,964.58	247,551,345	2,730.16	227,976,633	0.79
アメリカ	株式	COLGATE-PALMOLIVE CO	家庭用品・パーソナル用品	27,534	7,833.51	215,688,129	8,088.82	222,717,759	0.77
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	19,656	11,191.29	219,976,089	11,075.51	217,700,421	0.76
アメリカ	株式	YUM! BRANDS INC	消費者サービス	42,848	5,442.41	233,196,711	5,067.11	217,115,782	0.75
アメリカ	株式	DIRECTV-CLASS A	メディア	56,656	3,877.46	219,681,708	3,776.74	213,975,106	0.74
ドイツ	株式	SAP AG-SPONSORED ADR	ソフトウェア・サービス	47,516	4,852.97	230,594,145	4,458.80	211,864,730	0.74
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	53,915	3,384.95	182,499,622	3,792.60	204,478,255	0.71
パナマ	株式	CARNIVAL CORP	消費者サービス	76,000	2,532.36	192,459,990	2,675.91	203,369,874	0.71
アメリカ	株式	APPLIED MATERIALS INC	半導体・半導体製造装置	228,800	954.09	218,297,919	879.54	201,240,559	0.70
スイス	株式	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	運輸	25,013	9,201.41	230,154,908	7,978.48	199,565,732	0.69
スペイン	株式	BANCO SANTANDER CENTRAL HISP	銀行	407,075	494.68	201,374,873	482.34	196,350,549	0.68
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	14,550	13,148.41	191,309,481	13,392.00	194,853,730	0.68
スイス	株式	CREDIT SUISSE GROUP-REG	各種金融	142,104	1,864.45	264,947,136	1,363.04	193,693,691	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	106,969	1,767.38	189,055,683	1,780.31	190,438,536	0.66

(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

(2012年6月29日現在)

国内/外国	種類	業種	投資比率(%)
外国	株式	エネルギー	3.57
		素材	4.92
		資本財	4.52
		商業・専門サービス	1.18
		運輸	1.81
		自動車・自動車部品	2.44
		耐久消費財・アパレル	1.59
		消費者サービス	4.42
		メディア	3.49
		小売	4.04
		食品・生活必需品小売り	1.41
		食品・飲料・タバコ	10.93
		家庭用品・パーソナル用品	2.02
		ヘルスケア機器・サービス	3.73
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.59
		銀行	6.02
		各種金融	5.89
		保険	2.19
		ソフトウェア・サービス	8.50
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.01
電気通信サービス	2.77		
公益事業	0.51		
	半導体・半導体製造装置	3.68	
	投資証券		0.22
	合計		91.45

(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

(2012年6月29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315回 利付国債(10年)	1,868,000,000	104.11	1,944,816,100	104.21	1,946,773,560	1.2	2021年6月20日	16.51
日本	国債証券	第299回 利付国債(2年)	1,310,000,000	100.07	1,311,015,740	100.04	1,310,589,500	0.2	2012年12月15日	11.12
日本	国債証券	第121回 利付国債(20年)	530,000,000	103.56	548,908,100	104.97	556,346,300	1.9	2030年9月20日	4.72
日本	国債証券	第137回 利付国債(20年)	500,000,000	100.77	503,860,400	100.59	502,995,000	1.7	2032年6月20日	4.27
日本	国債証券	第96回 利付国債(5年)	470,000,000	101.26	475,938,200	101.40	476,598,800	0.5	2016年3月20日	4.04
日本	国債証券	第105回 利付国債(5年)	410,000,000	99.95	409,795,000	99.92	409,696,600	0.2	2017年6月20日	3.48
日本	国債証券	第33回 利付国債(30年)	346,000,000	102.73	355,468,710	102.59	354,961,400	2	2040年9月20日	3.01
日本	国債証券	第294回 利付国債(10年)	300,000,000	108.21	324,654,000	108.17	324,513,000	1.7	2018年6月20日	2.75
日本	国債証券	第290回 利付国債(10年)	270,000,000	106.11	286,519,200	106.32	287,080,200	1.4	2018年3月20日	2.44
日本	国債証券	第318回 利付国債(10年)	260,000,000	102.36	266,136,100	102.24	265,831,800	1	2021年9月20日	2.26
日本	国債証券	第114回 利付国債(20年)	223,000,000	107.08	238,788,400	108.45	241,852,420	2.1	2029年12月20日	2.05
日本	国債証券	第84回 利付国債(20年)	217,000,000	107.96	234,281,230	109.97	238,645,750	2	2025年12月20日	2.02
日本	国債証券	第289回 国庫短期証券	210,000,000	99.90	209,792,310	99.90	209,797,560	0	2013年6月20日	1.78
日本	国債証券	第304回 利付国債(2年)	180,000,000	100.09	180,165,000	100.08	180,154,800	0.2	2013年5月15日	1.53

日本	国債証券	第312回 利付国債(10年)	170,000,000	104.31	177,342,000	104.58	177,787,700	1.2	2020年12月20日	1.51
日本	国債証券	第313回 利付国債(10年)	156,000,000	104.02	162,276,600	105.27	164,224,320	1.3	2021年3月20日	1.39
日本	国債証券	第36回 利付国債(30年)	150,000,000	102.65	153,982,200	102.28	153,430,500	2	2042年3月20日	1.30
日本	国債証券	第316回 利付国債(10年)	120,000,000	103.42	124,104,000	103.37	124,048,800	1.1	2021年6月20日	1.05
日本	国債証券	第14回 利付国債(30年)	100,000,000	111.23	111,235,000	112.07	112,078,000	2.4	2034年3月20日	0.95
日本	国債証券	第92回 利付国債(5年)	100,000,000	100.40	100,408,000	100.64	100,641,000	0.3	2015年9月20日	0.85
日本	社債券	第11回 中央三井信託銀行株式会社無担保社債	200,000,000	102.22	204,449,000	103.18	206,364,000	1.64	2021年1月28日	1.75
日本	社債券	第9回 三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	102.00	102,009,000	104.16	104,161,000	1.68	2021年4月28日	0.88
日本	社債券	第49回 日本電信電話社債	100,000,000	104.05	104,052,000	103.86	103,865,000	1.45	2015年9月18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	103.31	103,317,000	102.96	102,965,000	1.92	2015年11月20日	0.87
日本	社債券	第58回 アコム株式会社無担保社債	100,000,000	101.02	101,020,000	101.95	101,955,000	3.67	2013年6月3日	0.86
日本	社債券	第148回 オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100.16	100,165,000	101.45	101,455,000	1.26	2017年2月24日	0.86
日本	社債券	第36回 鹿島建設株式会社無担保社債	100,000,000	101.08	101,089,000	101.18	101,181,000	1.24	2016年2月5日	0.86
日本	社債券	第2回 三越伊勢丹ホールディングス無担保社債	100,000,000	100.96	100,965,000	101.18	101,181,000	0.97	2015年9月2日	0.86
日本	社債券	第23回 コスモ石油株式会社無担保社債	100,000,000	101.10	101,107,000	101.04	101,041,000	1.44	2016年12月9日	0.86
日本	社債券	第3-2回 株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101.14	101,144,000	100.90	100,909,000	1.3	2013年6月26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

(2012年6月29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	3.34
	国債証券	72.31
	社債券	19.76
	合計	95.41

(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

(2012年6月29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 (%)
アメリカ	特殊債券	FNMA TBA	15,000,000	8,313.91	1,247,087,789	8,349.83	1,252,475,416	3.5	2042年7月12日	10.50
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	31,400,000	993.20	311,864,959	1,012.02	317,776,666	8.25	2017年9月15日	2.66
フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT INFL	2,600,000	11,108.25	313,903,815	10,904.45	308,479,275	2.1	2023年7月25日	2.59
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	3,100,000	7,920.39	245,532,313	7,920.39	245,532,313	-	2013年4月4日	2.06
ニュージーランド	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2,960,000	6,865.33	203,214,057	6,828.12	202,112,352	6	2015年4月15日	1.69
イギリス	国債証券	TSY	1,200,000	15,589.90	187,078,870	16,396.25	196,755,117	4.75	2030年12月7日	1.65
日本	特殊債券	JAPAN FIN OR G MUNICIPAL	180,000,000	106.92	192,469,920	106.82	192,284,640	2	2016年5月9日	1.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,900,000	8,553.76	162,521,607	8,690.63	165,121,992	3.125	2041年11月15日	1.38
フランス	社債券	DEXIA CREDIT LOCAL	2,200,000	7,379.08	162,339,797	7,459.90	164,117,996	0.94585	2014年4月29日	1.38
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000	10,758.31	161,374,731	10,931.50	163,972,581	3.65	2022年4月20日	1.37
フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT	1,300,000	12,947.57	168,318,523	12,537.01	162,981,231	5.5	2029年4月25日	1.37
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT	6,820,000	2,357.70	160,795,712	2,351.49	160,371,822	5.5	2015年4月25日	1.34
アメリカ	社債券	CITIGROUP INC	1,600,000	9,848.08	157,569,301	9,841.49	157,463,977	8.5	2019年5月22日	1.32
アイルランド	国債証券	IRISH TREASURY	1,810,000	8,579.71	155,292,861	8,524.46	154,292,747	5.4	2025年3月13日	1.29
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,450,000	9,636.16	139,724,392	10,539.58	152,823,985	4.25	2039年5月15日	1.28
ニュージーランド	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2,200,000	6,673.11	146,808,604	6,937.44	152,623,785	5	2019年3月15日	1.28
フランス	国債証券	FRENCH TREASURY NOTE	1,480,000	10,279.16	152,131,680	10,283.77	152,199,810	2.25	2016年2月25日	1.28
イギリス	社債券	ABBEY NATL TREASURY SERV	1,400,000	10,282.88	143,960,352	10,422.99	145,921,921	3.625	2016年10月14日	1.22
メキシコ	国債証券	MEXICAN FIXED RATE BONDS	22,420,000	621.69	139,385,067	650.49	145,840,023	7.5	2027年6月3日	1.22
イギリス	国債証券	TSY	930,000	14,805.18	137,688,174	15,387.53	143,104,099	4.25	2040年12月7日	1.20
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,670,000	8,310.20	138,780,356	8,302.80	138,656,848	2.375	2014年10月31日	1.16
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,420,000	10,042.59	142,604,850	9,296.53	132,010,850	4.5	2018年2月1日	1.11
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT	5,510,000	2,345.22	129,221,745	2,345.27	129,224,795	5.75	2014年4月25日	1.08
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,300,000	9,970.30	129,614,023	9,608.69	124,913,041	4.75	2016年9月15日	1.05
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,440,000	9,508.36	136,920,467	8,665.68	124,785,920	4	2020年9月1日	1.05
スペイン	特殊債券	INSTIT CRDT OFCL	1,600,000	7,776.34	124,421,528	7,695.28	123,124,523	0.71585	2013年1月28日	1.03
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,100,000	10,948.27	120,431,025	11,026.09	121,287,081	4	2016年9月15日	1.02
ニュージーランド	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1,600,000	7,148.91	114,382,694	7,519.51	120,312,192	6	2021年5月15日	1.01
メキシコ	国債証券	MEXICAN FIXED RATE BONDS	19,040,000	615.48	117,189,047	611.81	116,489,862	8	2013年12月19日	0.98
アイルランド	国債証券	IRELAND GOVERNMENT	1,370,000	8,491.64	116,335,468	8,376.21	114,754,117	4.5	2020年4月18日	0.96

(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。

投資有価証券種類別投資比率

(2012年6月29日現在)

国内 / 外国	種類	投資比率 (%)
国内	特殊債券	1.61
外国	国債証券	52.16
	地方債証券	5.47
	特殊債券	24.89
	社債券	21.49
	売付債券	2.1
	合計	101.42

(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

(2012年6月29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	2012年9月	買建	313	2,237,938,290	2,406,970,000	6.82

(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

(2012年6月29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&P500 EMINI 株価指数先物取引	2012年9月	買建	198	1,032,877,209	1,038,307,485	3.60
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	2012年9月	買建	139	293,555,705	295,084,490	1.02
シカゴ商業取引所	S&P 500 株価指数先物取引	2012年9月	買建	9	234,673,214	235,978,974	0.82
ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100 株価指数先物取引	2012年9月	買建	34	226,505,492	227,952,986	0.79
モントリオール取引所	S&P/TSE 60 株価指数先物取引	2012年9月	買建	11	109,164,560	110,169,556	0.38
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	2012年9月	買建	17	82,279,714	83,504,807	0.29
シドニー先物取引所	SPI 200 株価指数先物取引	2012年9月	買建	10	81,564,388	80,048,250	0.28
香港先物取引所	HANG SENG 株価指数先物取引	2012年7月	買建	5	48,670,534	48,545,000	0.17

(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

(2012年6月29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	2012年9月	買建	40,000,000	57,312,660	57,560,000	0.49

(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

(2012年6月29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 (%)
ユーレックス・ドイツ金融 先物取引所	EURO-BUND 債券先物取引	2012年9月	買建	55	769,019,383	769,584,497	6.45
ユーレックス・ドイツ金融 先物取引所	EURO-BOBL 債券先物取引	2012年9月	売建	54	679,820,368	672,840,032	5.64
シドニー先物取引所	AUST 3Y BOND 債券先物取引	2012年9月	売建	74	652,673,199	651,918,580	5.47
シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE 債券先物取引	2012年9月	買建	53	559,984,885	562,931,248	4.72
ユーレックス・ドイツ金融 先物取引所	EURO-BTP 債券先物取引	2012年9月	買建	10	99,649,247	96,241,878	0.81
ロンドン国際金融先物オブ ション取引所	LONG GILT 債券先物取引	2012年9月	売建	6	88,350,358	88,675,948	0.74
モントリオール取引所	CAN 10Y BOND 債券先物取引	2012年9月	売建	5	52,671,148	53,428,081	0.45

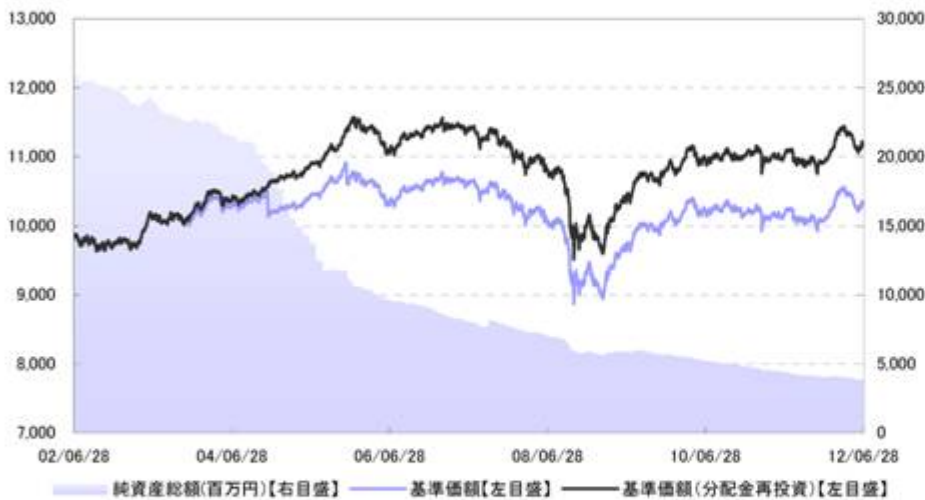
(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

[参考情報]

運用実績

三菱 UFJ MV20

1 基準価額・純資産の推移(2002年6月28日～2012年6月29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)を再投資したもとして計算

2 分配の推移

2011年12月	0円
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
設定来累計	836円

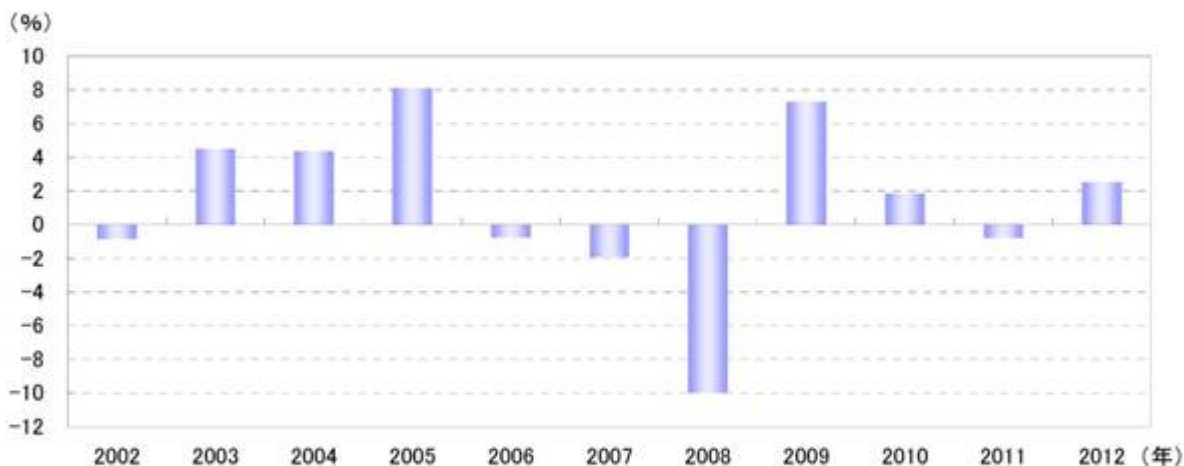
・分配金は1万口当たり、税引前

3 主要な資産の状況(2012年6月29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	38.8%
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	34.9%
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	15.3%
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	5.1%
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
- ・2012年は6月29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(2002年6月28日～2012年6月29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

2011年12月	0円
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
設定来累計	800円

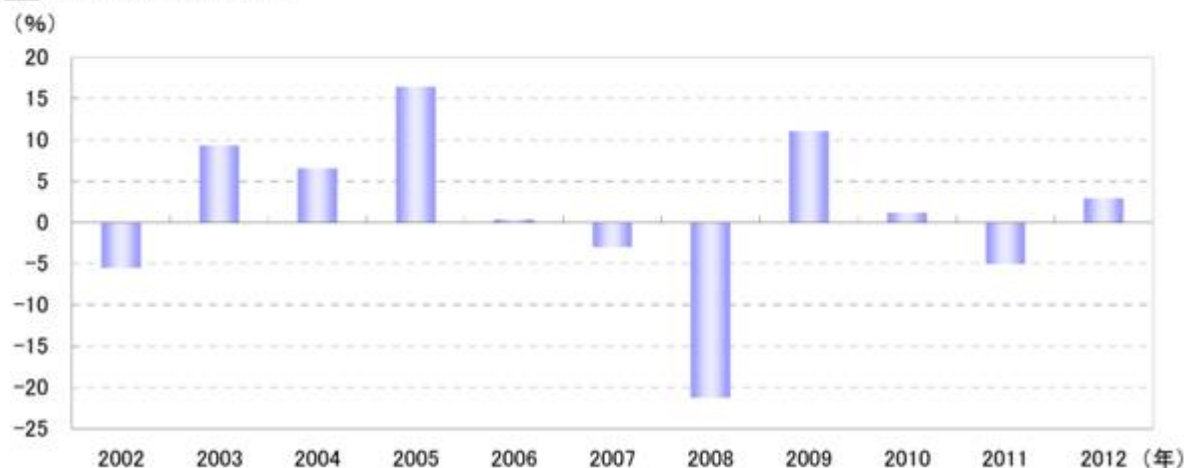
・分配金は1万口当たり、税引前

3 主要な資産の状況(2012年6月29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	30.6%
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	28.8%
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	24.8%
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	10.0%
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
- ・2012年は6月29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(2002年6月28日～2012年6月29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)を再投資したもとして計算

2 分配の推移

2011年12月	0円
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
設定来累計	650円

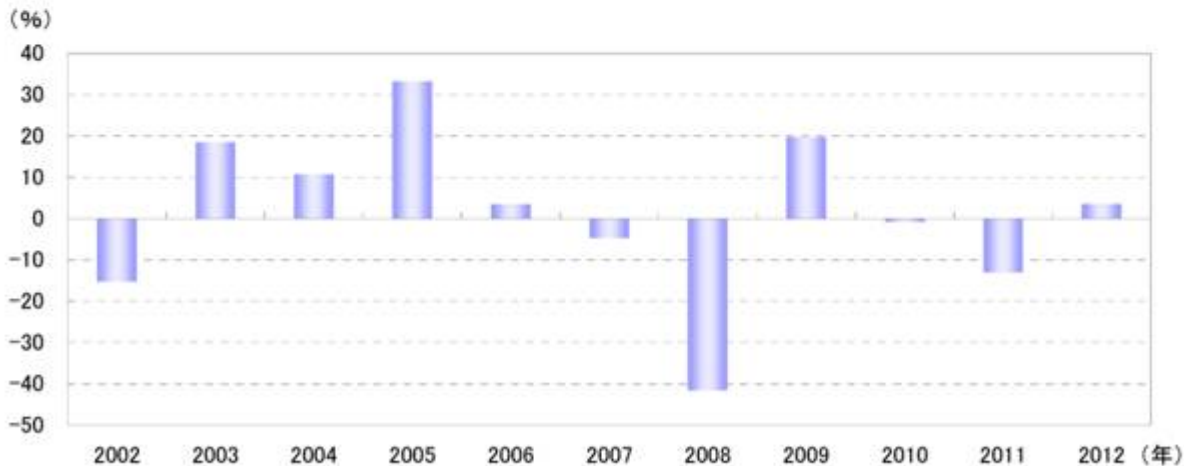
・分配金は1万口当たり、税引前

3 主要な資産の状況(2012年6月29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	55.6%
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	24.8%
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
- ・2012年は6月29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2【管理及び運営】**3【資産管理等の概要】****(5)【その他】**

<訂正前>

(略)

公告	委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。
----	---------------------------------

<訂正後>

(略)

公告	委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。 ただし、平成25年6月21日以降は、以下の通り変更される予定です。 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。 http://www.am.mufg.jp/ なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。
----	--

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。
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12期中間計算期間（平成23年12月13日から平成24年6月12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12期中間計算期間末
[平成24年6月12日現在]

資産の部		
流動資産		
コール・ローン	55,252,326	
投資信託受益証券	3,843,112,180	
未収利息	123	
流動資産合計	3,898,364,629	
資産合計	3,898,364,629	
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,034,938	
未払受託者報酬	422,689	
未払委託者報酬	14,371,242	
流動負債合計	23,828,869	
負債合計	23,828,869	
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 3,770,087,911	
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	104,447,849	
(分配準備積立金)	113,885,310	
元本等合計	3,874,535,760	
純資産合計	3,874,535,760	
負債純資産合計	3,898,364,629	

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第12期中間計算期間 自平成23年12月13日 至平成24年6月12日
営業収益	
受取利息	16,923
有価証券売買等損益	101,112,534
営業収益合計	101,129,457
営業費用	
受託者報酬	422,689
委託者報酬	14,371,242
営業費用合計	14,793,931
営業利益	86,335,526
経常利益	86,335,526
中間純利益	86,335,526
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	9,648,521
期首剰余金又は期首欠損金()	28,007,469
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,129,461
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,129,461
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,376,086
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,376,086
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金()	104,447,849

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券以外の有価証券 個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 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。</p>
-------------------	--

(中間貸借対照表に関する注記)

	第 12 期中間計算期間末 [平成24年6月12日現在]
1 期首元本額	4,069,865,887円
期中追加設定元本額	67,337,680円
期中一部解約元本額	367,115,656円
2 受益権の総数	3,770,087,911口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0277円 (10,277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 12 期中間計算期間末 [平成24年6月12日現在]
1 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価には、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る場合、当該価額が異なることもあります。</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	

(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12期中間計算期間末
[平成24年6月12日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	58,507,614
投資信託受益証券	4,017,036,791
未収利息	130
流動資産合計	4,075,544,535
資産合計	4,075,544,535
負債の部	
流動負債	
未払解約金	5,903,150
未払受託者報酬	445,030
未払委託者報酬	16,688,329
流動負債合計	23,036,509
負債合計	23,036,509
純資産の部	
元本等	
元本	¹ 4,246,718,187
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	² 194,210,161
(分配準備積立金)	323,630,694
元本等合計	4,052,508,026
純資産合計	4,052,508,026
負債純資産合計	4,075,544,535

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 12 期中間計算期間
	自 平成23年12月13日
	至 平成24年 6月12日
営業収益	
受取利息	17,342
有価証券売買等損益	78,406,247
営業収益合計	78,423,589
営業費用	
受託者報酬	445,030
委託者報酬	16,688,329
営業費用合計	17,133,359
営業利益	61,290,230
経常利益	61,290,230
中間純利益	61,290,230
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	9,918,918
期首剰余金又は期首欠損金 ()	259,381,582
剰余金増加額又は欠損金減少額	16,019,516
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	16,019,516
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,219,407
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,219,407
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金 ()	194,210,161

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券以外の有価証券 個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 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。</p>
-------------------	--

(中間貸借対照表に関する注記)

	第 12 期中間計算期間末 [平成24年6月12日現在]
1 期首元本額	4,443,783,958円
期中追加設定元本額	75,485,189円
期中一部解約元本額	272,550,960円
2 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	194,210,161円
3 受益権の総数	4,246,718,187口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9543円 (9,543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 12 期中間計算期間末 [平成24年6月12日現在]
1 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価には、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>
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12期中間計算期間末
[平成24年6月12日現在]

資産の部		
流動資産		
コール・ローン		43,166,001
投資信託受益証券		2,939,080,560
未収利息		96
流動資産合計		2,982,246,657
資産合計		2,982,246,657
負債の部		
流動負債		
未払解約金		2,191,537
未払受託者報酬		330,968
未払委託者報酬		14,893,601
流動負債合計		17,416,106
負債合計		17,416,106
純資産の部		
元本等		
元本	1	3,797,307,502
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2	832,476,951
(分配準備積立金)		478,044,684
元本等合計		2,964,830,551
純資産合計		2,964,830,551
負債純資産合計		2,982,246,657

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第12期中間計算期間 自平成23年12月13日 至平成24年6月12日
営業収益	
受取利息	14,682
有価証券売買等損益	15,245,882
営業収益合計	15,260,564
営業費用	
受託者報酬	330,968
委託者報酬	14,893,601
営業費用合計	15,224,569
営業利益	35,995
経常利益	35,995
中間純利益	35,995
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	9,001,071
期首剰余金又は期首欠損金()	846,540,491
剰余金増加額又は欠損金減少額	45,355,846
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	45,355,846
剰余金減少額又は欠損金増加額	22,327,230
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	22,327,230
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金()	832,476,951

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券以外の有価証券 個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 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。</p>
-------------------	--

(中間貸借対照表に関する注記)

	第 12 期中間計算期間末 [平成24年6月12日現在]
1 期首元本額	3,875,933,842円
期中追加設定元本額	128,991,788円
期中一部解約元本額	207,618,128円
2 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	832,476,951円
3 受益権の総数	3,797,307,502口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7808円 (7,808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 12 期中間計算期間末 [平成24年6月12日現在]
1 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価には、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>
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	当中間計算期間末 平成24年6月12日現在
	金 額
資産の部	
流動資産	
親投資信託受益証券	7,649,200,929
流動資産合計	7,649,200,929
資産合計	7,649,200,929
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	27,655
未払委託者報酬	207,969
流動負債合計	235,624
負債合計	235,624
純資産の部	
元本等	
元本	10,660,660,372
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,011,695,067
(分配準備積立金)	1,327,223,623
元本等合計	7,648,965,305
純資産合計	7,648,965,305
負債純資産合計	7,649,200,929

(2)中間損益及び剰余金計算書

(単位：円)

区 分	当中間計算期間 自 平成23年12月13日 至 平成24年 6月12日
	金 額
営業収益	
有価証券売買等損益	220,053,295
営業収益合計	220,053,295
営業費用	
受託者報酬	5,318,997
委託者報酬	39,998,818
営業費用合計	45,317,815
営業利益又は営業損失（ ）	265,371,110
経常利益又は経常損失（ ）	265,371,110
中間純利益又は中間純損失（ ）	265,371,110
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（ ）	67,825,716
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,723,079,217
剰余金増加額又は欠損金減少額	283,421,961
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	283,421,961
剰余金減少額又は欠損金増加額	238,840,985
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	238,840,985
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,011,695,067

(3)中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 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。
2. その他中間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23年12月11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23年12月12日としており、このため当中間計算期間は183日となっております。

(追加情報)

当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成24年6月12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	10,845,415,598円 943,840,994円 1,128,596,220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3,011,695,067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	10,660,660,372口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

当中間計算期間 自 平成23年12月13日 至 平成24年 6月12日 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	当中間計算期間末 平成24年6月12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 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「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)

当中間計算期間末 平成24年6月12日現在 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)

当中間計算期間末 平成24年6月12日現在 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	当中間計算期間末 平成24年6月12日現在
一口当たり純資産額 (一万口当たり純資産額)	0.7175円 (7,175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24年6月12日現在	
	金 額	
資産の部		
流動資産		
金銭信託		607,615
コール・ローン		2,880,092,625
株式		30,013,924,730
派生商品評価勘定		47,258,710
未収入金		151,859,993
未収配当金		348,149,225
未収利息		7,496
差入委託証拠金		49,356,290
流動資産合計		33,491,256,684
資産合計		33,491,256,684
負債の部		
流動負債		
未払金		170,430,815
未払解約金		1,182,753
流動負債合計		171,613,568
負債合計		171,613,568
純資産の部		
元本等		
元本		42,034,308,586
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		8,714,665,470
元本等合計		33,319,643,116
純資産合計		33,319,643,116
負債純資産合計		33,491,256,684

（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日から翌年4月18日までであり、開示対象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24年6月12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)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>有価証券 株式は移動平均法に基づき、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 時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における開示対象ファンドの中間計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は開示対象ファンドの中間計算期間末日において知りうる直近の最終相場）で評価しております。 開示対象ファンドの中間計算期間末日に当該金融商品取引所等の最終相場がない場合には、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でないと認められた場合は、当該金融商品取引所等における開示対象ファンドの中間計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。 ・金融商品取引所等に上場されていない有価証券 時価評価にあたっては、原則として日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融機関の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 ・時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
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、原則として開示対象ファンドの中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

(追加情報)

開示対象ファンドの中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成24年6月12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	
当該親投資信託の元本額	42,254,761,541円
期中追加設定元本額	2,974,772,962円
期中一部解約元本額	3,195,225,917円
元本の内訳	
ラッセル 日本株式ファンド - 2	
(適格機関投資家限定)	24,077,977,695円
ラッセル 日本株式ファンド	
(適格機関投資家限定)	9,649,553,336円
ラッセル 日本株式ファンド - 3	
(適格機関投資家限定)	4,762,266,857円
ラッセル 日本株式マルチ・マネージャー・ファンド	
(確定拠出年金向け)	2,731,693,706円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド	
安定型	60,313,945円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド	
安定・成長型	506,638,474円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド	
成長型	245,864,573円
計	42,034,308,586円
2. 元本の欠損	
貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は8,714,665,470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受益権の総数	42,034,308,586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24年6月12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、原則として開示対象ファンドの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	<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 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」の「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 「(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	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)

平成24年6月12日現在	
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24年6月12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	3,225,122,690		3,272,925,000	47,802,310
合計		3,225,122,690		3,272,925,000	47,802,310

(注)1. 株価指数先物取引の評価方法

原則として開示対象ファンドの中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、開示対象ファンドの中間計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

(一口当たり情報に関する注記)

区分	平成24年6月12日現在
一口当たり純資産額	0.7927円
(一万口当たり純資産額)	(7,927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	当中間計算期間末 平成24年6月12日現在
	金 額
資産の部	
流動資産	
親投資信託受益証券	2,972,158,793
流動資産合計	2,972,158,793
資産合計	2,972,158,793
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	10,841
未払委託者報酬	81,525
流動負債合計	92,366
負債合計	92,366
純資産の部	
元本等	
元本	3,365,677,581
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	393,611,154
(分配準備積立金)	352,294,827
元本等合計	2,972,066,427
純資産合計	2,972,066,427
負債純資産合計	2,972,158,793

(2)中間損益及び剰余金計算書

(単位：円)

区 分	当中間計算期間 自 平成23年12月13日 至 平成24年 6月12日
	金 額
営業収益	
有価証券売買等損益	157,480,438
営業収益合計	157,480,438
営業費用	
受託者報酬	2,106,182
委託者報酬	15,838,418
営業費用合計	17,944,600
営業利益又は営業損失（ ）	139,535,838
経常利益又は経常損失（ ）	139,535,838
中間純利益又は中間純損失（ ）	139,535,838
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（ ）	69,484,801
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	560,405,536
剰余金増加額又は欠損金減少額	108,028,547
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	108,028,547
剰余金減少額又は欠損金増加額	11,285,202
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	11,285,202
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	393,611,154

(3)中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 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。
2. その他中間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23年12月11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23年12月12日としており、このため当中間計算期間は183日となっております。

(追加情報)

当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成24年6月12日現在
1. 期首元本額	3,803,936,107円
期中追加設定元本額	302,285,208円
期中一部解約元本額	740,543,734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393,611,154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	3,365,677,581口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

当中間計算期間 自 平成23年12月13日 至 平成24年 6月12日
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	当中間計算期間末 平成24年6月12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 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「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)

当中間計算期間末 平成24年6月12日現在
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)

当中間計算期間末 平成24年6月12日現在
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	当中間計算期間末 平成24年6月12日現在
一口当たり純資産額 (一万口当たり純資産額)	0.8831円 (8,831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24年6月12日現在	
	金 額	
資産の部		
流動資産		
預金		1,485,235,013
コール・ローン		918,625,585
株式		26,009,722,154
投資証券		46,130,651
派生商品評価勘定		657,076,045
未収入金		195,578,406
未収配当金		40,429,878
未収利息		2,390
差入委託証拠金		165,556,282
流動資産合計		29,518,356,404
資産合計		29,518,356,404
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		705,203,833
未払金		218,108,489
未払解約金		82,875
その他未払費用		6,848,866
流動負債合計		930,244,063
負債合計		930,244,063
純資産の部		
元本等		
元本		31,426,917,407
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		2,838,805,066
元本等合計		28,588,112,341
純資産合計		28,588,112,341
負債純資産合計		29,518,356,404

（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日から翌年4月18日までであり、開示対象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24年6月12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)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>有価証券</p> <p>株式及び投資証券は移動平均法に基づき、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 時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における開示対象ファンドの中間計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は開示対象ファンドの中間計算期間末日において知りうる直近の最終相場）で評価しております。 開示対象ファンドの中間計算期間末日に当該金融商品取引所等の最終相場がない場合には、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によるのが適当でない認められた場合は、当該金融商品取引所等における開示対象ファンドの中間計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 時価評価にあたっては、原則として日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融機関の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
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、原則として開示対象ファンドの中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として開示対象ファンドの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>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(追加情報)

開示対象ファンドの中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成24年6月12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	
当該親投資信託の元本額	32,234,758,218円
期中追加設定元本額	1,452,853,828円
期中一部解約元本額	2,260,694,639円
元本の内訳	
ラッセル 外国株式ファンド - 2 （適格機関投資家限定）	23,313,830,190円
ラッセル 外国株式ファンド （適格機関投資家限定）	3,267,185,658円
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）	748,419,191円
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）	2,774,992,573円
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）	814,131,401円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド 安定型	32,615,254円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド 安定・成長型	291,026,032円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド 成長型	184,717,108円
計	31,426,917,407円
2. 元本の欠損	
貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,838,805,066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受益権の総数	31,426,917,407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24年6月12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、原則として開示対象ファンドの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	<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 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「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 「（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)

平成24年6月12日現在	
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24年6月12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	2,177,763,993		2,153,880,900	23,883,093
合計		2,177,763,993		2,153,880,900	23,883,093

(注) 1. 株価指数先物取引の評価方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また、契約額等及び時価の邦貨換算は開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っており、換算において円未満の端数は切り捨てております。

通貨関連（平成24年6月12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	11,255,491,680		10,611,606,481	643,885,199
	米ドル	6,503,445,059		6,244,627,326	258,817,733
	加ドル	133,536,203		125,655,664	7,880,539
	豪ドル	379,246,461		345,516,987	33,729,474
	英ポンド	579,995,734		545,407,551	34,588,183
	スイスフラン	312,561,013		290,356,289	22,204,724
	香港ドル	45,832,015		44,415,423	1,416,592
	シンガポールドル	5,989,033		5,855,401	133,632
	ニュージーランドドル	5,326,721		4,841,610	485,111
	スウェーデンクローネ	1,135,698,478		1,045,785,611	89,912,867
	ノルウェークローネ	188,125,935		171,164,855	16,961,080
	デンマーククローネ	36,161,631		33,717,646	2,443,985
	イスラエルシェケル	3,646,089		3,475,711	170,378
	ユーロ	1,925,927,308		1,750,786,407	175,140,901
	買建	12,144,741,680		11,476,611,786	668,129,894
	米ドル	6,522,296,621		6,271,864,102	250,432,519
	加ドル	658,859,013		605,736,707	53,122,306
	豪ドル	602,170,316		545,543,400	56,626,916
	英ポンド	1,040,046,504		983,211,377	56,835,127
	スイスフラン	601,004,089		548,219,918	52,784,171
	香港ドル	187,455,973		178,904,647	8,551,326
	シンガポールドル	64,501,905		59,967,665	4,534,240
	ニュージーランドドル	5,430,565		4,844,173	586,392
	スウェーデンクローネ	1,080,543,867		978,088,073	102,455,794
	ノルウェークローネ	201,835,441		190,559,310	11,276,131
	デンマーククローネ	7,233,696		6,833,878	399,818
	イスラエルシェケル	3,772,057		3,475,711	296,346
	ユーロ	1,169,591,633		1,099,362,825	70,228,808
	合計		23,400,233,360		22,088,218,267

(注) 1. 為替予約の評価方法

(1) 開示対象ファンドの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。

開示対象ファンドの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。

開示対象ファンドの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。

- ・開示対象ファンドの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相場の仲値をもとに計算しております。

- ・開示対象ファンドの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) 開示対象ファンドの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、開示対象ファンドの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	平成24年6月12日現在
一口当たり純資産額	0.9097円
(一万口当たり純資産額)	(9,097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	当中間計算期間末 平成24年6月12日現在
	金 額
資産の部	
流動資産	
親投資信託受益証券	2,956,946,360
流動資産合計	2,956,946,360
資産合計	2,956,946,360
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	8,479
未払委託者報酬	35,611
流動負債合計	44,090
負債合計	44,090
純資産の部	
元本等	
元本	2,523,648,500
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	433,253,770
(分配準備積立金)	262,277,428
元本等合計	2,956,902,270
純資産合計	2,956,902,270
負債純資産合計	2,956,946,360

(2)中間損益及び剰余金計算書

(単位：円)

区 分	当中間計算期間 自 平成23年12月13日 至 平成24年 6月12日
	金 額
営業収益	
有価証券売買等損益	46,857,414
営業収益合計	46,857,414
営業費用	
受託者報酬	1,619,612
委託者報酬	6,802,306
営業費用合計	8,421,918
営業利益又は営業損失（ ）	38,435,496
経常利益又は経常損失（ ）	38,435,496
中間純利益又は中間純損失（ ）	38,435,496
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（ ）	2,553,098
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	414,481,123
剰余金増加額又は欠損金減少額	24,435,872
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	24,435,872
剰余金減少額又は欠損金増加額	41,545,623
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	41,545,623
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	433,253,770

(3)中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 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。
2. その他中間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23年12月11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23年12月12日としており、このため当中間計算期間は183日となっております。

(追加情報)

当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成24年6月12日現在
1. 期首元本額	2,635,985,640円
期中追加設定元本額	151,564,133円
期中一部解約元本額	263,901,273円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	2,523,648,500口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

当中間計算期間 自 平成23年12月13日 至 平成24年 6月12日 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	当中間計算期間末 平成24年6月12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 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「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)

当中間計算期間末 平成24年6月12日現在 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)

当中間計算期間末 平成24年6月12日現在
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	当中間計算期間末 平成24年6月12日現在
一口当たり純資産額	1.1717円
(一万口当たり純資産額)	(11,717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24年6月12日現在	
	金 額	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		571,754,353
国債証券		8,403,136,540
社債券		2,829,045,000
派生商品評価勘定		110,680
未収入金		1,753,677,690
未収利息		21,110,397
前払費用		13,422,560
差入委託証拠金		4,909,155
流動資産合計		13,597,166,375
資産合計		13,597,166,375
負債の部		
流動負債		
未払金		1,758,107,960
未払解約金		17,589,565
流動負債合計		1,775,697,525
負債合計		1,775,697,525
純資産の部		
元本等		
元本		9,434,232,831
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		2,387,236,019
元本等合計		11,821,468,850
純資産合計		11,821,468,850
負債純資産合計		13,597,166,375

（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日から翌年11月18日までであり、開示対象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24年6月12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）

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、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 時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における開示対象ファンドの中間計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は開示対象ファンドの中間計算期間末日において知りうる直近の最終相場）で評価しております。 開示対象ファンドの中間計算期間末日に当該金融商品取引所等の最終相場がない場合には、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でないと認められた場合は、当該金融商品取引所等における開示対象ファンドの中間計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。 ・金融商品取引所等に上場されていない有価証券 時価評価にあたっては、原則として日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融機関の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 ・時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
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、原則として開示対象ファンドの中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

（追加情報）

開示対象ファンドの中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

平成24年6月12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	
当該親投資信託の元本額	9,576,424,416円
期中追加設定元本額	712,546,020円
期中一部解約元本額	854,737,605円
元本の内訳	
ラッセル 日本債券ファンド （適格機関投資家限定）	2,359,893,344円
ラッセル 日本債券ファンド - 2 （適格機関投資家限定）	455,672,859円
ラッセル 日本債券ファンド （適格機関投資家限定）	2,535,582,360円
ラッセル 日本債券ファンド - 1 （適格機関投資家限定）	3,994,472,319円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド 安定型	11,975,521円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド 安定・成長型	55,637,978円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド 成長型	20,998,450円
計	9,434,232,831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	9,434,232,831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24年6月12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、原則として開示対象ファンドの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ぬ。
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 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「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 「（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つた場合、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)

平成24年6月12日現在
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24年6月12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	114,624,000		114,736,000	112,000
合 計		114,624,000		114,736,000	112,000

(注) 1. 債券先物取引の評価方法

原則として開示対象ファンドの中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、開示対象ファンドの中間計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりませぬ。

(一口当たり情報に関する注記)

区 分	平成24年6月12日現在
一口当たり純資産額	1.2530円
(一万口当たり純資産額)	(12,530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	当中間計算期間末 平成24年6月12日現在
	金 額
資産の部	
流動資産	
親投資信託受益証券	2,489,186,473
派生商品評価勘定	31,971,685
流動資産合計	2,521,158,158
資産合計	2,521,158,158
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	708,575
未払受託者報酬	7,235
未払委託者報酬	54,258
流動負債合計	770,068
負債合計	770,068
純資産の部	
元本等	
元本	1,843,625,663
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	676,762,427
（分配準備積立金）	391,174,383
元本等合計	2,520,388,090
純資産合計	2,520,388,090
負債純資産合計	2,521,158,158

(2)中間損益及び剰余金計算書

（単位：円）

区 分	当中間計算期間 自 平成23年12月13日 至 平成24年 6月12日
	金 額
営業収益	
有価証券売買等損益	129,956,034
為替差損益	4,583,555
営業収益合計	134,539,589
営業費用	
受託者報酬	1,385,707
委託者報酬	10,392,714
営業費用合計	11,778,421
営業利益又は営業損失（ ）	122,761,168
経常利益又は経常損失（ ）	122,761,168
中間純利益又は中間純損失（ ）	122,761,168
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（ ）	10,965,242
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	610,979,782
剰余金増加額又は欠損金減少額	32,703,290
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	32,703,290
剰余金減少額又は欠損金増加額	78,716,571
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	78,716,571
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	676,762,427

(3)中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 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。
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。
3. その他中間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23年12月11日が休日のため、信託約款第42条により、前計算期間末日を平成23年12月12日としており、このため当中間計算期間は183日となっております。

(追加情報)

当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成24年6月12日現在
1. 期首元本額	2,005,647,131円
期中追加設定元本額	95,296,712円
期中一部解約元本額	257,318,180円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	1,843,625,663口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

当中間計算期間 自 平成23年12月13日 至 平成24年 6月12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。

(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	当中間計算期間末 平成24年6月12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 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「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 「（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)

当中間計算期間末 平成24年6月12日現在
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 当中間計算期間末（平成24年6月12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	2,541,319,195		2,510,202,191	31,117,004
	米ドル	1,101,347,938		1,100,326,630	1,021,308
	加ドル	75,427,089		74,787,378	639,711
	豪ドル	37,955,033		38,121,181	166,148
	英ポンド	206,339,469		202,316,962	4,022,507
	スイスフラン	10,650,402		10,396,371	254,031
	シンガポールドル	23,510,886		23,257,979	252,907
	スウェーデンクローネ	23,296,877		23,254,492	42,385
	ユーロ	1,062,791,501		1,037,741,198	25,050,303
	買建	4,004,907		4,151,013	146,106
	豪ドル	1,568,149		1,631,512	63,363
	スイスフラン	90,902		93,066	2,164
	シンガポールドル	237,688		243,098	5,410
	スウェーデンクローネ	2,108,168		2,183,337	75,169
	合計	2,545,324,102		2,514,353,204	31,263,110

(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	当中間計算期間末 平成24年6月12日現在
一口当たり純資産額 (一万口当たり純資産額)	1.3671円 (13,671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	当中間計算期間末 平成24年6月12日現在
	金 額
資産の部	
流動資産	
親投資信託受益証券	543,168,386
流動資産合計	543,168,386
資産合計	543,168,386
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	1,576
未払委託者報酬	11,817
流動負債合計	13,393
負債合計	13,393
純資産の部	
元本等	
元本	342,501,899
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	200,653,094
(分配準備積立金)	107,825,631
元本等合計	543,154,993
純資産合計	543,154,993
負債純資産合計	543,168,386

(2)中間損益及び剰余金計算書

(単位：円)

区 分	当中間計算期間 自 平成23年12月13日 至 平成24年 6月12日
	金 額
営業収益	
有価証券売買等損益	27,656,767
営業収益合計	27,656,767
営業費用	
受託者報酬	300,062
委託者報酬	2,250,390
営業費用合計	2,550,452
営業利益又は営業損失（ ）	25,106,315
経常利益又は経常損失（ ）	25,106,315
中間純利益又は中間純損失（ ）	25,106,315
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	3,439,032
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	192,035,042
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,605,469
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,605,469
剰余金減少額又は欠損金増加額	16,654,700
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	16,654,700
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	200,653,094

(3)中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 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。
2. その他中間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23年12月11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23年12月12日としており、このため当中間計算期間は183日となっております。

(追加情報)

当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成24年6月12日現在
1. 期首元本額	368,013,634円
期中追加設定元本額	6,394,532円
期中一部解約元本額	31,906,267円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	342,501,899口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

当中間計算期間 自 平成23年12月13日 至 平成24年 6月12日
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	当中間計算期間末 平成24年6月12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 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「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)

当中間計算期間末 平成24年6月12日現在
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)

当中間計算期間末 平成24年6月12日現在
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	当中間計算期間末 平成24年6月12日現在
一口当たり純資産額 (一万口当たり純資産額)	1,5858円 (15,858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 分	平成24年6月12日現在	
	金 額	
資産の部		
流動資産		
預金		242,908,702
コール・ローン		454,463,201
国債証券		5,756,244,861
地方債証券		651,119,693
特殊債券		2,811,509,058
社債券		2,882,184,780
派生商品評価勘定		506,020,204
未収入金		3,175,098,009
未収利息		107,293,706
前払費用		32,596,479
差入委託証拠金		236,174,284
流動資産合計		16,855,612,977
資産合計		16,855,612,977
負債の部		
流動負債		
売付債券		249,371,775
コール・オプション(売)		87,032
プット・オプション(売)		144,897
派生商品評価勘定		440,832,214
未払金		4,328,571,935
その他未払費用		1,439,609
流動負債合計		5,020,447,462
負債合計		5,020,447,462
純資産の部		
元本等		
元本		6,203,139,397
剰余金		
剰余金又は欠損金()		5,632,026,118
元本等合計		11,835,165,515
純資産合計		11,835,165,515
負債純資産合計		16,855,612,977

(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日から翌年3月13日までであり、開示対象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24年6月12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）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>有価証券 組入有価証券及び売付債券は個別法に基づき、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 時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における開示対象ファンドの中間計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は開示対象ファンドの中間計算期間末日において知りうる直近の最終相場）で評価しております。 開示対象ファンドの中間計算期間末日に当該金融商品取引所等の最終相場がない場合には、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でない認められた場合は、当該金融商品取引所等における開示対象ファンドの中間計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。 ・金融商品取引所等に上場されていない有価証券 時価評価にあたっては、原則として日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融機関の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 ・時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
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、原則として開示対象ファンドの中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として開示対象ファンドの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仲値、仲値が発表されていない場合には発表されている先物相場のうち受渡日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。</p> <p>(3) オプション取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として開示対象ファンドの中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する証拠金算定基準値段、最終相場又は金融商品取引業者等の提示する価額によって評価しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 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処理処理を採用しております。</p>

（追加情報）

開示対象ファンドの中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

平成24年6月12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	
当該親投資信託の元本額	6,581,768,166円
期中追加設定元本額	649,206,410円
期中一部解約元本額	1,027,835,179円
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） （適格機関投資家限定）	1,304,673,449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）	284,694,369円
ラッセル 外国債券ファンド - 2 （適格機関投資家限定）	2,423,919,088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）	1,386,616,603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）	327,420,872円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド 安定型	115,915,841円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド 安定・成長型	307,720,858円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド 成長型	52,178,317円
計	6,203,139,397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	6,203,139,397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24年6月12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、原則として開示対象ファンドの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ぬ。
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 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「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 「（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	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つた場合、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）

平成24年6月12日現在	
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24年6月12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	2,008,547,208		2,005,133,835	3,413,373
	売建	2,488,382,810		2,494,707,508	6,324,698
	債券オプション取引				
	売建	214,652,770 (830,435)		231,929	598,506
	コール	57,757,600 (174,064)		87,032	87,032
	プット	156,895,170 (656,371)		144,897	511,474
	合計	4,711,582,788 (830,435)		4,500,073,272	9,139,565

(注) 1. 債券先物取引

(1) 債券先物取引の評価方法

原則として開示対象ファンドの中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、開示対象ファンドの中間計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(2) 債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(3) 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また、契約額等及び時価の邦貨換算は開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っており、換算において円未満の端数は切り捨てております。

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

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

(2) 換算において、円未満の端数は切り捨てております。

(3) オプション取引における()内は、受取オプション料であります。

金利関連（平成24年6月12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	788,557,740		788,399,220	158,520
	合計	788,557,740		788,399,220	158,520

(注) 1. 金利先物取引の評価方法

原則として開示対象ファンドの中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、開示対象ファンドの中間計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 金利先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(3) 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っており、換算において円未満の端数は切り捨てております。

通貨関連(平成24年6月12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	16,051,084,928	-	15,608,454,800	442,630,128
	米ドル	7,306,582,670	-	7,196,488,123	110,094,547
	加ドル	195,499,320	-	199,118,350	3,619,030
	豪ドル	1,110,920,845	-	1,087,980,303	22,940,542
	英ポンド	734,472,266	-	730,977,985	3,494,281
	スイスフラン	17,006,610	-	16,562,400	444,210
	香港ドル	54,181,476	-	54,128,461	53,015
	シンガポールドル	201,456,640	-	190,745,610	10,711,030
	ニュージーランドドル	1,075,131,728	-	1,049,219,159	25,912,569
	スウェーデンクローネ	166,253,590	-	165,665,760	587,830
	ノルウェークローネ	36,293,450	-	35,828,500	464,950
	デンマーククローネ	7,682,540	-	7,480,220	202,320
	メキシコペソ	345,117,204	-	317,098,730	28,018,474
	ポーランドズロチ	704,889,013	-	645,267,738	59,621,275
	南アフリカランド	289,040,550	-	277,981,088	11,059,462
	ユーロ	3,806,557,026	-	3,633,912,373	172,644,653
	買建	16,221,356,038	-	15,853,810,491	367,545,547
	米ドル	9,426,019,884	-	9,281,185,448	144,834,436
	加ドル	405,856,425	-	384,173,150	21,683,275
	豪ドル	326,054,092	-	324,295,527	1,758,565
	英ポンド	1,120,589,023	-	1,097,841,279	22,747,744
	スイスフラン	49,395,335	-	48,204,000	1,191,335
	香港ドル	54,714,405	-	54,124,343	590,062
	シンガポールドル	228,904,229	-	218,139,329	10,764,900
	ニュージーランドドル	377,580,815	-	375,464,240	2,116,575
	スウェーデンクローネ	399,965,880	-	384,324,370	15,641,510
	デンマーククローネ	115,177,196	-	112,389,640	2,787,556
	メキシコペソ	212,460,834	-	199,956,961	12,503,873
	ポーランドズロチ	379,011,497	-	369,997,562	9,013,935
	南アフリカランド	88,291,976	-	79,572,576	8,719,400
	ユーロ	3,037,334,447	-	2,924,142,066	113,192,381
	合計	32,272,440,966	-	31,462,265,291	75,084,581

(注) 1. 為替予約の評価方法

(1) 開示対象ファンドの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。開示対象ファンドの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。開示対象ファンドの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。

- ・開示対象ファンドの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相場の仲値をもとに計算しております。
- ・開示対象ファンドの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) 開示対象ファンドの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、開示対象
ファンドの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	平成24年6月12日現在
一口当たり純資産額	1.9079円
(一万口当たり純資産額)	(19,079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24年6月29日現在

(単位:円)

資産総額	3,894,592,246
負債総額	3,566,120
純資産総額(-)	3,891,026,126
発行済口数	3,761,092,800 口
1口当たり純資産価額(/)	1.0345 (1万口当たり 10,345)

「三菱UFJ MV40」

純資産額計算書

平成24年6月29日現在

(単位:円)

資産総額	4,110,669,418
負債総額	10,050,212
純資産総額(-)	4,100,619,206
発行済口数	4,244,930,365 口
1口当たり純資産価額(/)	0.9660 (1万口当たり 9,660)

「三菱UFJ MV80」

純資産額計算書

平成24年6月29日現在

(単位:円)

資産総額	3,038,004,738
負債総額	5,569,094
純資産総額(-)	3,032,435,644
発行済口数	3,800,528,579 口
1口当たり純資産価額(/)	0.7979 (1万口当たり 7,979)

[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）

(2012年6月29日現在)

種類	金額	単位
資産総額	8,129,579,853	円
負債総額	106,293,535	円
純資産総額（ - ）	8,023,286,318	円
発行済口数	10,534,114,809	口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7616	円

ラッセル 外国株式ファンド（適格機関投資家限定）

(2012年6月29日現在)

種類	金額	単位
資産総額	3,039,413,697	円
負債総額	6,671,172	円
純資産総額（ - ）	3,032,742,525	円
発行済口数	3,415,917,524	口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8878	円

ラッセル 日本債券ファンド（適格機関投資家限定）

(2012年6月29日現在)

種類	金額	単位
資産総額	2,956,699,995	円
負債総額	792,844	円
純資産総額（ - ）	2,955,907,151	円
発行済口数	2,523,640,849	口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1713	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）

(2012年6月29日現在)

種類	金額	単位
資産総額	2,529,680,393	円
負債総額	4,701,394	円
純資産総額（ - ）	2,524,978,999	円
発行済口数	1,844,336,574	口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3690	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)

(2012年6月29日現在)

種類	金額	単位
資産総額	544,250,225	円
負債総額	240,134	円
純資産総額(-)	544,010,091	円
発行済口数	342,501,899	口
1口当たり純資産額(/)	1.5883	円

(参考)ラッセル 日本株式マザーファンド

(2012年6月29日現在)

種類	金額	単位
資産総額	35,706,932,419	円
負債総額	411,114,375	円
純資産総額(-)	35,295,818,044	円
発行済口数	41,923,826,159	口
1口当たり純資産額(/)	0.8419	円

(参考)ラッセル 外国株式マザーファンド

(2012年6月29日現在)

種類	金額	単位
資産総額	29,200,894,911	円
負債総額	389,026,902	円
純資産総額(-)	28,811,868,009	円
発行済口数	31,485,418,196	口
1口当たり純資産額(/)	0.9151	円

(参考)ラッセル 日本債券マザーファンド

(2012年6月29日現在)

種類	金額	単位
資産総額	12,592,164,872	円
負債総額	803,873,720	円
純資産総額(-)	11,788,291,152	円
発行済口数	9,408,548,760	口
1口当たり純資産額(/)	1.2529	円

(参考)ラッセル 外国債券マザーファンド

(2012年6月29日現在)

種類	金額	単位
資産総額	13,815,622,696	円
負債総額	1,888,565,075	円
純資産総額(-)	11,927,057,621	円
発行済口数	6,238,993,211	口
1口当たり純資産額(/)	1.9117	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23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24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23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24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24年6月29日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	385	5,532,015
追加型公社債投資信託	18	455,151
単位型株式投資信託	8	29,822
単位型公社債投資信託	6	101,364
合計	417	6,118,352

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。

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27期事業年度（自平成23年4月1日 至平成24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り監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第26期 (平成23年3月31日現在)		第27期 (平成24年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	2	17,056,128	2	14,298,590
有価証券	2	10,000,000	2	8,000,000
前払費用		156,230		154,925
未収入金	2	19,641		13,813
未収委託者報酬		4,517,987		3,977,324
未収収益	2	63,656	2	42,563
繰延税金資産		429,080		339,052
金銭の信託	2	30,000	2	30,000
その他		28,070		27,621
流動資産合計		32,300,796		26,883,891
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	306,543	1	281,399
器具備品	1	184,985	1	177,757
土地		1,205,031		1,205,031
有形固定資産合計		1,696,560		1,664,188
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		909,905		881,368
ソフトウェア仮勘定		146,761		402,721
その他		68		24
無形固定資産合計		1,072,557		1,299,937
投資その他の資産				
投資有価証券		9,405,012		14,456,313
関係会社株式		431,812		320,136
長期性預金	2	7,000,000	2	8,500,000
長期差入保証金	2	797,041	2	837,456
長期前払費用		52		
繰延税金資産		442,254		139,650
その他		15,035		15,035
投資その他の資産合計		18,091,208		24,268,591
固定資産合計		20,860,326		27,232,718
資産合計		53,161,123		54,116,609

(単位：千円)

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	47,528	79,079
未払金		
未払収益分配金	245,085	185,817
未払償還金	1,328,820	1,159,445
未払手数料	2 1,768,519	2 1,557,726
その他未払金	104,042	50,899
未払費用	2 1,240,586	2 1,174,572
未払消費税等	184,873	63,602
未払法人税等	2,228,870	1,532,874
賞与引当金	550,000	520,000
その他	227,518	278,521
流動負債合計	7,925,844	6,602,539
固定負債		
退職給付引当金	105,461	119,902
役員退職慰労引当金	76,024	49,735
時効後支払損引当金	196,123	195,228
固定負債合計	377,609	364,866
負債合計	8,303,454	6,967,405
(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	34,903,313	36,863,331
利益剰余金合計	42,243,903	44,203,921
株主資本合計	44,466,131	46,426,148
評価・換算差額等		
その他有価証券	391,537	723,054
評価差額金		
評価・換算差額等合計	391,537	723,054
純資産合計	44,857,668	47,149,203
負債純資産合計	53,161,123	54,116,609

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)		第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		48,411,622		47,476,170
投資顧問料		16,400		15,335
その他営業収益		236,596		153,305
営業収益合計		48,664,618		47,644,812
営業費用				
支払手数料	2	19,778,797	2	19,292,904
広告宣伝費		696,640		516,886
公告費		7,795		7,961
調査費				
調査費		895,558		909,999
委託調査費		8,991,373		9,975,300
事務委託費		243,109		306,137
営業雑経費				
通信費		98,144		90,066
印刷費		569,763		400,552
協会費		37,616		40,636
諸会費		6,248		7,593
事務機器関連費		880,509		958,507
その他営業雑経費				16,396
営業費用合計		32,205,558		32,522,943
一般管理費				
給料				
役員報酬		199,168		202,812
給料・手当		3,576,037		3,623,556
賞与引当金繰入		550,000		520,000
福利厚生費		492,032		520,897
交際費		23,412		26,743
旅費交通費		156,920		153,892
租税公課		108,850		102,255
不動産賃借料		655,939		698,539
退職給付費用		163,440		142,883
役員退職慰労引当金繰入		18,106		22,805
固定資産減価償却費		406,176		481,601
諸経費		369,603		247,162
一般管理費合計		6,719,689		6,743,148
営業利益		9,739,370		8,378,719

(単位：千円)

	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)		第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		29,543		153,215
有価証券利息	2	11,040	2	8,160
受取利息	2	20,465	2	25,661
投資有価証券償還益		371,171		1,876
収益分配金等時効完成分		438,693		318,285
その他		8,257		7,856
営業外収益合計		879,170		515,056
営業外費用				
投資有価証券償還損		192,004		
時効後支払損引当金繰入		666		15,288
事務過誤費		32,187		7,845
その他		7,757		82
営業外費用合計		232,615		23,216
経常利益		10,385,925		8,870,559
特別利益				
投資有価証券売却益		351,930		150,103
特別利益合計		351,930		150,103
特別損失				
投資有価証券売却損		127,114		153,276
関係会社株式売却損				13,563
投資有価証券評価損				1,925
過年度時効後支払損引当金繰入		204,138		
固定資産除却損	1	3,431	1	17,034
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		412
特別損失合計		374,378		186,212
税引前当期純利益		10,363,477		8,834,449
法人税、住民税及び事業税		4,027,373		3,510,046
法人税等調整額		25,800		175,067
法人税等合計		4,001,573		3,685,113
当期純利益		6,361,903		5,149,336

(3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	31,383,254	34,903,313
当期変動額		
剰余金の配当	2,841,844	3,189,318
当期純利益	6,361,903	5,149,336
当期変動額合計	3,520,059	1,960,017
当期末残高	34,903,313	36,863,331
利益剰余金合計		
当期首残高	38,723,843	42,243,903
当期変動額		
剰余金の配当	2,841,844	3,189,318
当期純利益	6,361,903	5,149,336
当期変動額合計	3,520,059	1,960,017
当期末残高	42,243,903	44,203,921
株主資本合計		
当期首残高	40,946,071	44,466,131
当期変動額		
剰余金の配当	2,841,844	3,189,318
当期純利益	6,361,903	5,149,336
当期変動額合計	3,520,059	1,960,017
当期末残高	44,466,131	46,426,148
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	1,277,237	391,537
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	885,699	331,516
当期変動額合計	885,699	331,516
当期末残高	391,537	723,054
繰延ヘッジ損益		
当期首残高	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	
当期変動額合計	62,258	
当期末残高		
評価・換算差額等合計		
当期首残高	1,214,979	391,537
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	823,441	331,516
当期変動額合計	823,441	331,516
当期末残高	391,537	723,054
純資産合計		
当期首残高	42,161,050	44,857,668
当期変動額		
剰余金の配当	2,841,844	3,189,318
当期純利益	6,361,903	5,149,336
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	823,441	331,516
当期変動額合計	2,696,617	2,291,534
当期末残高	44,857,668	47,149,203

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

移動平均法による原価法によっております。

2. 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。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 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。

4. 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。

(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。

(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。

(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。

5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。

[追加情報]

(会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用)

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1.有形固定資産の減価償却累計額

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
建物	181,085千円	208,976千円
器具備品	227,109千円	294,294千円

2.関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
預金	13,335,700千円	11,773,728千円
有価証券	10,000,000千円	8,000,000千円
未収入金	1,500千円	-
未収収益	63,656千円	42,563千円
金銭の信託	30,000千円	30,000千円
長期性預金	7,000,000千円	8,500,000千円
長期差入保証金	788,590千円	828,908千円
未払手数料	986,786千円	851,491千円
未払費用	134,713千円	135,926千円

(損益計算書関係)

1.固定資産除却損の内訳

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
器具備品	3,431千円	1,144千円
ソフトウェア	-	15,890千円
計	3,431千円	17,034千円

2.関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
支払手数料	11,685,424千円	10,760,427千円
有価証券利息	8,718千円	6,532千円
受取利息	20,465千円	25,661千円

(株主資本等変動計算書関係)

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

	当事業年度期首 株式数(株)	当事業年度増加 株式数(株)	当事業年度減少 株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
発行済株式				
普通株式	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

第27期(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	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
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

(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24年6月26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	2,581,238千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	20,800円
基準日	平成24年3月31日
効力発生日	平成24年6月27日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、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

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)。

第26期(平成23年3月31日現在)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	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	-
資産計	47,714,871	47,725,447	10,576
(1) 未払手数料	1,768,519	1,768,519	-
(2) 未払法人税等	2,228,870	2,228,870	-
負債計	3,997,389	3,997,389	-

第27期(平成24年3月31日現在)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	14,298,590	14,298,590	-
(2) 有価証券	8,000,000	8,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	3,977,324	3,977,324	-
(4) 長期性預金	8,500,000	8,509,886	9,886
(5) 投資有価証券	14,417,413	14,417,413	-
資産計	49,193,328	49,203,214	9,886
(1) 未払手数料	1,557,726	1,557,726	-
(2) 未払法人税等	1,532,874	1,532,874	-
負債計	3,090,600	3,090,600	-

(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

資産

(1) 現金及び預金、(2) 有価証券、(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。

負債

(1)未払手数料、(2)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

(単位：千円)

区分	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
非上場株式	264,257	38,900
子会社株式	431,812	160,600
関連会社株式	-	159,536

非上場株式は、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、子会社株式及び関連会社株式は、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

第26期（平成23年3月31日現在）

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	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	-

第27期（平成24年3月31日現在）

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	14,298,590	-	-	-
未収委託者報酬	3,977,324	-	-	-
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	8,000,000	-	-	-
投資信託	-	3,168,056	4,412,092	2,183,060
長期性預金	-	8,500,000	-	-
合計	26,275,914	11,668,056	4,412,092	2,183,060

(有価証券関係)

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（当事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円、前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式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

第26期（平成23年3月31日現在）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	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

第27期（平成24年3月31日現在）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	11,092,127	9,993,766	1,098,361
	小計	11,092,127	9,993,766	1,098,361
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	3,325,285	3,446,474	121,188
	小計	3,325,285	3,446,474	121,188
	合計	14,417,413	13,440,240	977,173

3. 売却したその他有価証券

第26期（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

第27期（自平成23年4月1日至平成24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	158,639	-	64,792
債券	-	-	-
その他	3,036,630	150,103	88,484
合計	3,195,269	150,103	153,276

(デリバティブ取引関係)
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、従業員に対して確定拠出年金制度、退職一時金制度及び確定給付年金制度を設けております。なお、平成23年10月に適格退職年金制度を廃止し、確定給付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26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
(1)退職給付債務	567,377	475,564
(2)年金資産	309,065	198,994
(3)未積立退職給付債務 (1)+(2)	258,311	276,569
(4)未認識数理計算上の差異	152,850	156,666
(5)貸借対照表計上額純額 (3)+(4)	105,461	119,902
(6)退職給付引当金	105,461	119,902

3.退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
(1)勤務費用	28,585	27,806
(2)利息費用	9,774	8,420
(3)期待運用収益	6,248	4,635
(4)数理計算上の差異の費用処理額	37,969	13,599
(5)退職給付費用	70,080	45,191
(6)その他	93,360	97,692
(7)合計	163,440	142,883

(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.退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

(1)退職給付見込額の期間配分方法
期間定額基準

(2)割引率

第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
1.5%	1.5%

(3)期待運用収益率

第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
1.5%	1.5%

(4)数理計算上の差異の処理年数

8年（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による定額法により、翌事業年度より費用処理しております。）

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	651,260 千円	557,868 千円
投資有価証券評価損	408,754	362,665
ゴルフ会員権評価損	9,710	8,505
未払事業税	172,269	109,608
賞与引当金	223,795	197,652
役員退職慰労引当金	30,934	17,725
退職給付引当金	42,912	42,783
減価償却超過額	39,127	19,890
委託者報酬	92,577	99,265
長期差入保証金	20,080	21,895
時効後支払損引当金	79,802	69,579
その他	34,708	39,304
繰延税金資産 小計	1,805,934	1,546,744
評価性引当額	898,045	813,923
繰延税金資産 合計	907,888	732,821
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	36,553	254,118
繰延税金負債 合計	36,553	254,118
繰延税金資産(負債)の純額	871,334	478,702

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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
法定実効税率 (調整)	40.7 %	法定実効税率と税効果会計 適用後の法人税等の負担税率 との間の差異が法定実効税率 の100分の5以下であるため注 記を省略しております。
投資有価証券評価損認容	2.9	
その他	0.8	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	38.6	

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引き下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、従来の40.7%から、平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.0%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、35.6%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は39,177千円減少し、法人税等調整額が75,184千円、その他有価証券評価差額金が36,007千円、それぞれ増加しております。

（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）及び第27期（自平成23年4月1日至平成24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）及び第27期（自平成23年4月1日至平成24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]

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]

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]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第26期（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	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	事務所賃借料	631,409 千円	長期差入保証金	783,794 千円
							投資の助言	投資助言料	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	譲渡性預金の預入	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
								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
								長期性預金	7,000,000 千円		

第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
----	--------	-----	-----	-------	----------------	-----------	-------	------	----	------

親会社	三菱UFJ 信託銀行(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 50.0%	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	4,404,897 千円	未払手数料	285,119 千円
						事務所の賃借	事務所賃借 料	667,780 千円	長期差入保 証金	812,027 千円
						投資の助言	投資助言料	168,292 千円	未払費用	81,330 千円
							株式の売却	98,112 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 25.0%	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	6,371,303 千円	未払手数料	566,371 千円
						取引銀行	譲渡性預金 の預入	36,000,000 千円	有価証券	8,000,000 千円
							譲渡性預金 に係る受取 利息	6,532 千円	未収利息	544 千円
							マルチコー ラブル預金 の預入	7,000,000 千円	現金及び 預金	5,500,000 千円
							マルチコー ラブル預金 に係る受取 利息	24,415 千円	長期性預金	8,500,000 千円
			未収利息	2,886 千円						

(注) 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。

売却価額については、第三者機関による企業価値評価をもとに決定しております。

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
第26期（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	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㈱	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

第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	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㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	3,914,481 千円	未払手数料	285,874 千円

(注)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）

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

(1株当たり情報)

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
1株当たり純資産額	361,469.71円	379,935.23円
1株当たり当期純利益金額	51,265.16円	41,494.11円

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
当期純利益金額(千円)	6,361,903	5,149,336
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額(千円)	6,361,903	5,149,336
期中平均株式数(株)	124,098	124,098

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】**1【名称、資本金の額及び事業の内容】****(1) 受託会社**

< 訂正前 >

(略)

資本金の額：324,279百万円(平成23年9月末現在)

(略)

< 訂正後 >

(略)

資本金の額：324,279百万円(平成24年3月末現在)

(略)

(2) 販売会社

< 更新後 >

名称	資本金の額 (平成24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	40,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

3【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23年12月末現在)

(略)

< 訂正後 >

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。(平成24年6月末現在)

(略)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年7月24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23年12月13日から平成24年6月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、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表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

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24年6月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成23年12月13日から平成24年6月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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24年7月24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23年12月13日から平成24年6月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、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表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

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24年6月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成23年12月13日から平成24年6月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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24年7月24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23年12月13日から平成24年6月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、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表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

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24年6月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成23年12月13日から平成24年6月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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24年6月26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	長島 拓也	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23年4月1日から平成24年3月31日までの第27期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。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表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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が含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

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24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。

利害関係

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

以 上

（注）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](#)