

**【表紙】**

**【提出書類】** 半期報告書

**【提出先】** 関東財務局長

**【提出日】** 平成26年9月11日

**【計算期間】** 第14期中（自平成25年12月13日 至平成26年6月12日）

**【ファンド名】** 三菱UFJ MV20  
三菱UFJ MV40  
三菱UFJ MV80

**【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 金上 孝

**【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

**【縦覧に供する場所】** 該当ありません

## 1【ファンドの運用状況】

## 【三菱UFJ MV20】

## (1)【投資状況】

平成26年6月30日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	3,153,633,458	97.97
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		65,459,397	2.03
純資産総額		3,219,092,855	100.00

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

## (2)【運用実績】

## 【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成26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4計算期間末日 (平成16年12月13日)	19,397,039,013 (分配付) 18,749,155,611 (分配落)	10,479 (分配付) 10,129 (分配落)
第5計算期間末日 (平成17年12月12日)	11,739,247,647 (分配付) 11,416,361,985 (分配落)	10,907 (分配付) 10,607 (分配落)
第6計算期間末日 (平成18年12月12日)	9,178,061,823 (分配付) 9,178,061,823 (分配落)	10,631 (分配付) 10,631 (分配落)
第7計算期間末日 (平成19年12月12日)	7,822,290,447 (分配付) 7,822,290,447 (分配落)	10,501 (分配付) 10,501 (分配落)
第8計算期間末日 (平成20年12月12日)	5,811,746,403 (分配付) 5,811,746,403 (分配落)	9,214 (分配付) 9,214 (分配落)
第9計算期間末日 (平成21年12月14日)	5,669,321,448 (分配付) 5,669,321,448 (分配落)	10,004 (分配付) 10,004 (分配落)
第10計算期間末日 (平成22年12月13日)	4,891,633,236 (分配付) 4,843,800,835 (分配落)	10,227 (分配付) 10,127 (分配落)
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)
第12計算期間末日 (平成24年12月12日)	3,834,764,554 (分配付) 3,709,840,638 (分配落)	10,744 (分配付) 10,394 (分配落)
第13計算期間末日 (平成25年12月12日)	3,427,518,410 (分配付) 3,279,053,205 (分配落)	11,543 (分配付) 11,043 (分配落)
平成25年 6月末日	3,622,296,865	11,104
7月末日	3,617,328,229	11,236
8月末日	3,536,219,714	11,156
9月末日	3,571,934,171	11,391
10月末日	3,539,117,089	11,463
11月末日	3,525,126,528	11,585
12月末日	3,273,403,921	11,106
平成26年 1月末日	3,169,804,625	11,072
2月末日	3,147,498,090	11,114
3月末日	3,125,907,200	11,097
4月末日	3,106,735,272	11,072
5月末日	3,125,421,782	11,186
6月末日	3,219,092,855	11,296

## 【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第4計算期間	350円
第5計算期間	300円
第6計算期間	0円

	1万口当たりの分配金
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
第12計算期間	350円
第13計算期間	500円

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
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12計算期間	6.70
第13計算期間	11.05
第13計算期間末日から 平成26年6月末日までの期間	2.29

（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13計算期間末日から平成26年6月末日までの期間については平成26年6月末日の基準価額から前期末基準価額を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数。

## 【三菱UFJ MV40】

## （1）【投資状況】

平成26年6月30日現在  
（単位：円）

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	3,358,335,437	97.45
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		87,837,458	2.55
純資産総額		3,446,172,895	100.00

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

## （2）【運用実績】

## 【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成26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）

	純資産総額	基準価額 (1万口当たりの純資産価額)
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)
第12計算期間末日 (平成24年12月12日)	4,083,872,104 (分配付) 4,083,872,104 (分配落)	10,128 (分配付) 10,128 (分配落)
第13計算期間末日 (平成25年12月12日)	3,658,868,724 (分配付) 3,511,857,924 (分配落)	12,444 (分配付) 11,944 (分配落)
平成25年 6月末日	3,914,987,232	11,644
7月末日	3,899,684,797	11,885
8月末日	3,800,686,309	11,747
9月末日	3,875,240,054	12,190
10月末日	3,799,384,468	12,251
11月末日	3,759,230,724	12,507
12月末日	3,458,221,575	12,105
平成26年 1月末日	3,388,924,160	11,951
2月末日	3,370,907,619	11,987
3月末日	3,329,196,024	11,923
4月末日	3,279,401,710	11,850
5月末日	3,276,300,177	12,018
6月末日	3,446,172,895	12,213

## 【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
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
第12計算期間	0円
第13計算期間	500円

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
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12計算期間	7.56
第13計算期間	22.86
第13計算期間末日から 平成26年6月末日までの期間	2.25

(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13計算期間末日から平成26年6月末日までの期間については平成26年6月末日の基準価額から前期末基準価額を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数。

## 【三菱UFJ MV80】

## (1) 【投資状況】

平成26年6月30日現在  
(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	3,666,902,462	97.57
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		91,160,734	2.43
純資産総額		3,758,063,196	100.00

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

## (2) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成26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)
第12計算期間末日 (平成24年12月12日)	3,214,231,719 (分配付) 3,214,231,719 (分配落)	8,583 (分配付) 8,583 (分配落)
第13計算期間末日 (平成25年12月12日)	3,777,623,527 (分配付) 3,629,745,011 (分配落)	12,773 (分配付) 12,273 (分配落)
平成25年 6月末日	3,776,198,263	11,316
7月末日	3,834,509,390	11,749
8月末日	3,736,984,067	11,512
9月末日	3,935,443,129	12,297
10月末日	3,845,986,254	12,361
11月末日	3,873,802,564	12,879
12月末日	3,744,304,105	12,649
平成26年 1月末日	3,586,265,440	12,232
2月末日	3,584,592,399	12,273
3月末日	3,521,204,991	12,130
4月末日	3,461,181,180	11,978
5月末日	3,535,731,300	12,226
6月末日	3,758,063,196	12,561

## 【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
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

	1万口当たりの分配金
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
第12計算期間	0円
第13計算期間	500円

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
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12計算期間	9.81
第13計算期間	48.81
第13計算期間末日から 平成26年6月末日までの期間	2.34

(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13計算期間末日から平成26年6月末日までの期間については平成26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。

## 2【設定及び解約の実績】

## 「三菱UFJ MV20」

	設定口数	解約口数	発行済口数
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	154,067,536	654,678,665	3,569,254,758
第13計算期間	261,230,083	861,180,733	2,969,304,108
第14計算期期首から 平成26年6月30日までの期間	217,902,617	337,562,717	2,849,644,008

## 「三菱UFJ MV40」

	設定口数	解約口数	発行済口数
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	160,240,731	571,819,688	4,032,205,001
第13計算期間	226,129,087	1,318,118,086	2,940,216,002
第14計算期期首から 平成26年6月30日までの期間	293,815,679	412,328,807	2,821,702,874

## 「三菱UFJ MV80」

	設定口数	解約口数	発行済口数
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	240,837,545	372,076,993	3,744,694,394
第13計算期間	355,037,389	1,142,161,450	2,957,570,333
第14計算期期首から 平成26年6月30日までの期間	375,934,169	341,619,872	2,991,884,630

### 3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期中間計算期間（平成25年12月13日から平成26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13期 [平成25年12月12日現在]	第14期中間計算期間末 [平成26年6月12日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	197,397,250	41,158,053
投資信託受益証券	3,251,428,303	3,116,053,808
未収入金	36,000,000	-
未収利息	334	80
流動資産合計	3,484,825,887	3,157,211,941
資産合計	3,484,825,887	3,157,211,941
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	148,465,205	-
未払解約金	44,132,238	1,958,349
未払受託者報酬	376,432	334,986
未払委託者報酬	12,798,807	11,389,520
流動負債合計	205,772,682	13,682,855
負債合計	205,772,682	13,682,855
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 2,969,304,108	<sup>1</sup> 2,793,816,783
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	309,749,097	349,712,303
(分配準備積立金)	242,126,786	216,918,290
元本等合計	3,279,053,205	3,143,529,086
純資産合計	3,279,053,205	3,143,529,086
負債純資産合計	3,484,825,887	3,157,211,941

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第 13 期中間計算期間 自 平成24年12月13日 至 平成25年 6月12日	第 14 期中間計算期間 自 平成25年12月13日 至 平成26年 6月12日
<b>営業収益</b>		
受取利息	14,809	11,520
有価証券売買等損益	286,301,665	70,625,505
営業収益合計	286,316,474	70,637,025
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	399,778	334,986
委託者報酬	13,592,539	11,389,520
営業費用合計	13,992,317	11,724,506
<b>営業利益</b>	272,324,157	58,912,519
経常利益	272,324,157	58,912,519
<b>中間純利益</b>	272,324,157	58,912,519
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	29,724,428	1,241,775
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	140,585,880	309,749,097
剰余金増加額又は欠損金減少額	13,893,244	15,726,245
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	13,893,244	15,726,245
剰余金減少額又は欠損金増加額	18,652,430	33,433,783
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	18,652,430	33,433,783
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	378,426,423	349,712,303

「三菱UFJ MV20」

(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	投資信託受益証券は移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあつては、基準価額で評価しております。
-------------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

	第 13 期 [ 平成25年12月12日現在 ]	第 14 期中間計算期間末 [ 平成26年6月12日現在 ]
1 期首元本額	3,569,254,758円	2,969,304,108円
期中追加設定元本額	261,230,083円	147,993,998円
期中一部解約元本額	861,180,733円	323,481,323円
2 受益権の総数	2,969,304,108口	2,793,816,783口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1043円 (11,043円)	1.1252円 (11,252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 13 期 [ 平成25年12月12日現在 ]	第 14 期中間計算期間末 [ 平成26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。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>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。</p>	<p>同 左</p> <p>同 左</p> <p>同 左</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。	同 左

(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13期 [平成25年12月12日現在]	第14期中間計算期間末 [平成26年6月12日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	200,403,292	42,138,731
投資信託受益証券	3,485,963,504	3,277,065,488
未収入金	14,000,000	-
未収利息	339	82
流動資産合計	3,700,367,135	3,319,204,301
資産合計	3,700,367,135	3,319,204,301
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	147,010,800	-
未払解約金	25,855,356	1,119,306
未払受託者報酬	406,316	355,859
未払委託者報酬	15,236,739	13,344,464
流動負債合計	188,509,211	14,819,629
負債合計	188,509,211	14,819,629
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 2,940,216,002	<sup>1</sup> 2,718,955,662
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	571,641,922	585,429,010
(分配準備積立金)	435,351,755	379,485,001
元本等合計	3,511,857,924	3,304,384,672
純資産合計	3,511,857,924	3,304,384,672
負債純資産合計	3,700,367,135	3,319,204,301

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第 13 期中間計算期間 自 平成24年12月13日 至 平成25年 6月12日	第 14 期中間計算期間 自 平成25年12月13日 至 平成26年 6月12日
<b>営業収益</b>		
受取利息	15,210	11,392
有価証券売買等損益	625,310,741	70,101,984
営業収益合計	625,325,951	70,113,376
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	440,774	355,859
委託者報酬	16,529,048	13,344,464
営業費用合計	16,969,822	13,700,323
<b>営業利益</b>	608,356,129	56,413,053
経常利益	608,356,129	56,413,053
<b>中間純利益</b>	608,356,129	56,413,053
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	95,835,878	77,325
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	51,667,103	571,641,922
剰余金増加額又は欠損金減少額	13,792,955	33,909,027
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	13,792,955	33,909,027
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,225,518	76,457,667
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,225,518	76,457,667
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	567,754,791	585,429,010

「三菱UFJ MV40」

(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	投資信託受益証券は移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあつては、基準価額で評価しております。
-------------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

	第 13 期 [ 平成25年12月12日現在 ]	第 14 期中間計算期間末 [ 平成26年6月12日現在 ]
1 期首元本額	4,032,205,001円	2,940,216,002円
期中追加設定元本額	226,129,087円	174,042,235円
期中一部解約元本額	1,318,118,086円	395,302,575円
2 受益権の総数	2,940,216,002口	2,718,955,662口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1944円 (11,944円)	1.2153円 (12,153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 13 期 [ 平成25年12月12日現在 ]	第 14 期中間計算期間末 [ 平成26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。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>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。</p>	<p>同 左</p> <p>同 左</p> <p>同 左</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。	同 左

(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 13 期 [平成25年12月12日現在]	第 14 期中間計算期間末 [平成26年6月12日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	207,467,387	53,667,349
投資信託受益証券	3,600,122,859	3,566,807,328
未収入金	-	8,000,000
未収利息	351	105
流動資産合計	3,807,590,597	3,628,474,782
資産合計	3,807,590,597	3,628,474,782
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	147,878,516	-
未払解約金	11,333,314	17,590,830
未払受託者報酬	405,081	378,177
未払委託者報酬	18,228,675	17,017,792
流動負債合計	177,845,586	34,986,799
負債合計	177,845,586	34,986,799
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 2,957,570,333	<sup>1</sup> 2,878,361,852
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	672,174,678	715,126,131
(分配準備積立金)	526,961,564	471,867,195
元本等合計	3,629,745,011	3,593,487,983
純資産合計	3,629,745,011	3,593,487,983
負債純資産合計	3,807,590,597	3,628,474,782

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第 13 期中間計算期間 自 平成24年12月13日 至 平成25年 6月12日	第 14 期中間計算期間 自 平成25年12月13日 至 平成26年 6月12日
<b>営業収益</b>		
受取利息	14,560	13,818
有価証券売買等損益	1,012,082,285	79,684,469
営業収益合計	1,012,096,845	79,698,287
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	390,729	378,177
委託者報酬	17,582,707	17,017,792
営業費用合計	17,973,436	17,395,969
<b>営業利益</b>	994,123,409	62,302,318
経常利益	994,123,409	62,302,318
<b>中間純利益</b>	994,123,409	62,302,318
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	127,742,726	271,704
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	530,462,675	672,174,678
剰余金増加額又は欠損金減少額	103,032,502	54,905,703
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	85,196,640	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	17,835,862	54,905,703
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	73,984,864
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	73,984,864
<b>分配金</b>	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	438,950,510	715,126,131



「三菱UFJ MV80」

(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	投資信託受益証券は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、基準価額で評価しております。
-------------------	--

(中間貸借対照表に関する注記)

	第 13 期 [ 平成25年12月12日現在 ]	第 14 期中間計算期間末 [ 平成26年6月12日現在 ]
1 期首元本額	3,744,694,394円	2,957,570,333円
期中追加設定元本額	355,037,389円	247,907,489円
期中一部解約元本額	1,142,161,450円	327,115,970円
2 受益権の総数	2,957,570,333口	2,878,361,852口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2273円 (12,273円)	1.2484円 (12,484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 13 期 [ 平成25年12月12日現在 ]	第 14 期中間計算期間末 [ 平成26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。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>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。</p>	<p>同 左</p> <p>同 左</p> <p>同 左</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。	同 左

(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](#)

## &lt;参考&gt;

当ファンドは投資信託受益証券を投資対象としております。  
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の状況は以下の通りです。

「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）」および「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。

[次へ](#)

## 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26年 6月11日現在
	金 額
資産の部	
流動資産	
親投資信託受益証券	6,563,518,133
未収入金	25,000,000
流動資産合計	6,588,518,133
資産合計	6,588,518,133
負債の部	
流動負債	
未払解約金	25,000,000
未払受託者報酬	4,378,693
未払委託者報酬	32,927,730
流動負債合計	62,306,423
負債合計	62,306,423
純資産の部	
元本等	
元本	5,057,890,479
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,468,321,231
(分配準備積立金)	1,554,280,513
元本等合計	6,526,211,710
純資産合計	6,526,211,710
負債純資産合計	6,588,518,133

## (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25年12月12日 至 平成26年 6月11日
	金 額
営業収益	
有価証券売買等損益	1,408,340
営業収益合計	1,408,340
営業費用	
受託者報酬	4,378,693
委託者報酬	32,927,730
営業費用合計	37,306,423
営業利益又は営業損失( )	38,714,763
経常利益又は経常損失( )	38,714,763
中間純利益又は中間純損失( )	38,714,763
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( )	21,286,339
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,630,941,711
剰余金増加額又は欠損金減少額	146,187,266
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減 少額	146,187,266
剰余金減少額又は欠損金増加額	291,379,322
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増 加額	291,379,322
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,468,321,231

## (3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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。
-----------------	--

## (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26年 6月11日現在
1. 期首元本額	5,468,984,718円
期中追加設定元本額	571,812,755円
期中一部解約元本額	982,906,994円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	5,057,890,479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25年12月12日 至 平成26年 6月11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26年 6月11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	<p>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。</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>
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26年 6月11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26年 6月11日現在
該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成26年 6月11日現在
1口当たり純資産額	1.2903円
(1万口当たり純資産額)	(12,903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26年 6月11日現在
	金 額
資産の部	
流動資産	
金銭信託	880,493
コール・ローン	1,571,363,391
株式	38,334,744,000
投資証券	33,005,000
派生商品評価勘定	3,276,300
未収入金	462,959,186
未収配当金	317,051,595
未収利息	2,367
差入委託証拠金	96,984,097
流動資産合計	40,820,266,429
資産合計	40,820,266,429
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,153,700
未払金	407,699,477
未払解約金	52,400,700
流動負債合計	462,253,877
負債合計	462,253,877
純資産の部	
元本等	
元本	27,708,392,585
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	12,649,619,967
元本等合計	40,358,012,552
純資産合計	40,358,012,552
負債純資産合計	40,820,266,429

(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25年12月11日及び平成26年6月11日における同親投資信託の状況であります。

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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"> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> </ul>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として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>



## (貸借対照表に関する注記)

平成26年 6月11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	28,821,726,315円
期中追加設定元本額	1,459,027,677円
期中一部解約元本額	2,572,361,407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)	15,585,209,737円
ラッセル 日本株式ファンド (適格機関投資家限定)	4,506,363,291円
ラッセル 日本株式ファンド - 3 (適格機関投資家限定)	4,367,758,891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)	2,923,552,823円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド 安定型	22,753,329円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド 安定・成長型	157,223,831円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド 成長型	145,530,683円
計	27,708,392,585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	
	27,708,392,585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26年 6月11日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額</p> <p>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> <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>	<p>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。</p> <p>有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>有価証券 「（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> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （有価証券に関する注記）

平成26年 6月11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26年 6月11日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,988,644,200	-	1,989,960,000	1,315,800
合計		1,988,644,200	-	1,989,960,000	1,315,800

## (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。

## (1口当たり情報に関する注記)

区 分	平成26年 6月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4565円 (14,565円)

[前へ](#)   [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26年 6月11日現在
	金 額
資産の部	
流動資産	
親投資信託受益証券	2,624,011,379
流動資産合計	2,624,011,379
資産合計	2,624,011,379
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	1,789,029
未払委託者報酬	13,453,408
流動負債合計	15,242,437
負債合計	15,242,437
純資産の部	
元本等	
元本	1,446,644,200
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,162,124,742
(分配準備積立金)	940,425,230
元本等合計	2,608,768,942
純資産合計	2,608,768,942
負債純資産合計	2,624,011,379

## (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25年12月12日 至 平成26年 6月11日
	金 額
営業収益	
有価証券売買等損益	215,154,156
営業収益合計	215,154,156
営業費用	
受託者報酬	1,789,029
委託者報酬	13,453,408
営業費用合計	15,242,437
営業利益又は営業損失( )	199,911,719
経常利益又は経常損失( )	199,911,719
中間純利益又は中間純損失( )	199,911,719
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( )	17,776,314
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,151,306,506
剰余金増加額又は欠損金減少額	88,139,908
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減 少額	88,139,908
剰余金減少額又は欠損金増加額	259,457,077
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増 加額	259,457,077
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,162,124,742

## (3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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。
-----------------	--

## (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26年 6月11日現在
1. 期首元本額	1,703,550,700円
期中追加設定元本額	126,860,114円
期中一部解約元本額	383,766,614円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	1,446,644,200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25年12月12日 至 平成26年 6月11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26年 6月11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	<p>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。</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>
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26年 6月11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26年 6月11日現在
該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成26年 6月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8033円 (18,033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26年 6月11日現在	
	金 額	
資産の部		
流動資産		
預金		1,082,319,245
コール・ローン		1,299,270,072
株式		41,667,763,500
投資証券		377,611,554
派生商品評価勘定		165,080,167
未収入金		256,333,017
未収配当金		48,286,677
未収利息		1,957
差入委託証拠金		408,989,921
流動資産合計		45,305,656,110
資産合計		45,305,656,110
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		174,080,528
未払金		276,639,311
未払解約金		9,987,658
その他未払費用		6,636,419
流動負債合計		467,343,916
負債合計		467,343,916
純資産の部		
元本等		
元本		23,636,479,849
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		21,201,832,345
元本等合計		44,838,312,194
純資産合計		44,838,312,194
負債純資産合計		45,305,656,110

(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25年12月11日及び平成26年6月11日における同親投資信託の状況であります。



## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>有価証券 株式及び投資証券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"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ul>
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おいて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発表されている対顧客先物相場の仲値によっております。</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計理処理を採用しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

平成26年 6月11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	24,133,399,840円
期中追加設定元本額	766,439,254円
期中一部解約元本額	1,263,359,245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)	17,889,579,618円
ラッセル 外国株式ファンド	
(適格機関投資家限定)	1,383,242,688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)	891,431,506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)	2,244,467,565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)	1,037,046,227円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド	
安定型	11,623,350円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド	
安定・成長型	80,724,902円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド	
成長型	98,363,993円
計	23,636,479,849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	
	23,636,479,849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26年 6月11日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額</p> <p>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> <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>	<p>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。</p> <p>有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>有価証券 「（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> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （有価証券に関する注記）

平成26年 6月11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26年 6月11日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,178,865,041	-	3,280,885,647	102,020,606
	売建	1,344,240,980	-	1,485,777,515	141,536,535
合計		4,523,106,021	-	4,766,663,162	39,515,929

(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。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26年 6月11日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引 以外の取 引	為替予約取引				
	買建	4,543,331,730	-	4,518,968,292	24,363,438
	米ドル	3,569,117,969	-	3,550,450,157	18,667,812
	カナダドル	116,090,725	-	117,068,360	977,635
	ユーロ	311,192,821	-	305,461,935	5,730,886
	英ポンド	272,291,263	-	272,048,753	242,510
	スイスフラン	116,378,572	-	113,358,900	3,019,672
	デンマーククローネ	4,332,213	-	4,298,347	33,866
	オーストラリアドル	101,874,722	-	104,564,240	2,689,518
	香港ドル	52,053,445	-	51,717,600	335,845
	売建	3,269,331,730	-	3,214,452,724	54,879,006
	米ドル	1,399,213,761	-	1,394,194,866	5,018,895
	カナダドル	58,050,140	-	58,582,600	532,460
	ユーロ	1,049,064,569	-	1,016,434,858	32,629,711
	英ポンド	126,628,060	-	126,315,000	313,060
	スイスフラン	571,598,800	-	553,719,000	17,879,800
	オーストラリアドル	43,713,400	-	44,086,400	373,000
	香港ドル	21,063,000	-	21,120,000	57,000
	合計	7,812,663,460	-	7,733,421,016	30,515,568

(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相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

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相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算しております。
- ・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相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

(2) 開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客電信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。

(1口当たり情報に関する注記)

区 分	平成26年 6月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8970円 (18,970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26年 6月11日現在
	金 額
資産の部	
流動資産	
親投資信託受益証券	2,488,969,556
流動資産合計	2,488,969,556
資産合計	2,488,969,556
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	1,339,856
未払委託者報酬	5,627,324
流動負債合計	6,967,180
負債合計	6,967,180
純資産の部	
元本等	
元本	2,059,355,563
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	422,646,813
(分配準備積立金)	222,810,945
元本等合計	2,482,002,376
純資産合計	2,482,002,376
負債純資産合計	2,488,969,556

## (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25年12月12日	至 平成26年 6月11日
	金 額	
営業収益		
有価証券売買等損益		26,158,708
営業収益合計		26,158,708
営業費用		
受託者報酬		1,339,856
委託者報酬		5,627,324
営業費用合計		6,967,180
営業利益又は営業損失( )		19,191,528
経常利益又は経常損失( )		19,191,528
中間純利益又は中間純損失( )		19,191,528
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( )		895,420
期首剰余金又は期首欠損金( )		432,175,880
剰余金増加額又は欠損金減少額		27,299,423
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		27,299,423
剰余金減少額又は欠損金増加額		55,124,598
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		55,124,598
中間剰余金又は中間欠損金( )		422,646,813

## (3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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。
-----------------	--

## (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26年 6月11日現在
1. 期首元本額	2,202,634,946円
期中追加設定元本額	137,700,586円
期中一部解約元本額	280,979,969円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	2,059,355,563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25年12月12日 至 平成26年 6月11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26年 6月11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	<p>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。</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>
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る場合、当該価額が異なることもあります。

## （有価証券に関する注記）

当中間計算期間末 平成26年 6月11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26年 6月11日現在
該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

区 分	当中間計算期間末 平成26年 6月11日現在
1口当たり純資産額	1.2052円
(1万口当たり純資産額)	(12,052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26年 6月11日現在	
	金 額	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		481,060,538
国債証券		8,170,181,800
社債券		2,766,418,460
派生商品評価勘定		14,680
未収入金		360,617,600
未収利息		19,463,509
前払費用		16,317,295
差入委託証拠金		5,816,680
流動資産合計		11,819,890,562
資産合計		11,819,890,562
負債の部		
流動負債		
未払金		632,268,680
未払解約金		8,000,000
流動負債合計		640,268,680
負債合計		640,268,680
純資産の部		
元本等		
元本		8,580,073,127
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		2,599,548,755
元本等合計		11,179,621,882
純資産合計		11,179,621,882
負債純資産合計		11,819,890,562

(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25年12月11日及び平成26年6月11日における同親投資信託の状況であります。

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>有価証券</p> <p>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"> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> </ul>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 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>

## (貸借対照表に関する注記)

平成26年 6月11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	8,893,130,943円
期中追加設定元本額	491,888,054円
期中一部解約元本額	804,945,870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)	1,910,183,850円
ラッセル 日本債券ファンド - 2 (適格機関投資家限定)	204,685,794円
ラッセル 日本債券ファンド (適格機関投資家限定)	1,352,121,662円
ラッセル 日本債券ファンド - 1 (適格機関投資家限定)	5,056,382,993円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド 安定型	8,262,040円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド 安定・成長型	28,801,774円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド 成長型	19,635,014円
計	8,580,073,127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	
	8,580,073,127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26年 6月11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</p> <p>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>
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>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>
	<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26年 6月11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26年 6月11日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	債券先物取引 買建	116,168,000	-	116,184,000	16,000
合計		116,168,000	-	116,184,000	16,000

## (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ん。

## (1口当たり情報に関する注記)

区 分	平成26年 6月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3030円 (13,030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26年 6月11日現在
	金 額
資産の部	
流動資産	
親投資信託受益証券	2,113,641,903
派生商品評価勘定	2,305,255
流動資産合計	2,115,947,158
資産合計	2,115,947,158
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,310,546
未払受託者報酬	1,130,054
未払委託者報酬	8,475,300
流動負債合計	19,915,900
負債合計	19,915,900
純資産の部	
元本等	
元本	1,429,181,208
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	666,850,050
(分配準備積立金)	380,615,565
元本等合計	2,096,031,258
純資産合計	2,096,031,258
負債純資産合計	2,115,947,158



## (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25年12月12日	至 平成26年 6月11日
	金 額	
営業収益		
有価証券売買等損益		74,578,554
為替差損益		20,082,804
営業収益合計		94,661,358
営業費用		
受託者報酬		1,130,054
委託者報酬		8,475,300
営業費用合計		9,605,354
営業利益又は営業損失( )		85,056,004
経常利益又は経常損失( )		85,056,004
中間純利益又は中間純損失( )		85,056,004
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( )		2,839,089
期首剰余金又は期首欠損金( )		644,159,953
剰余金増加額又は欠損金減少額		24,384,630
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		24,384,630
剰余金減少額又は欠損金増加額		83,911,448
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		83,911,448
中間剰余金又は中間欠損金( )		666,850,050

## (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発表されている対顧客先物相場の仲値によっております。

## (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26年 6月11日現在
1. 期首元本額	1,575,815,295円
期中追加設定元本額	58,615,374円
期中一部解約元本額	205,249,461円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	1,429,181,208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25年12月12日 至 平成26年 6月11日
信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、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26年 6月11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	<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)

当中間計算期間末 平成26年 6月11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26年 6月11日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引 以外の取 引	為替予約取引				
	買建	10,739,707	-	10,752,201	12,494
	米ドル	9,168,680	-	9,183,220	14,540
	スイスフラン	77,417	-	77,316	101
	スウェーデンクローネ	1,493,610	-	1,491,665	1,945
	売建	2,109,524,231	-	2,117,542,016	8,017,785
	米ドル	825,105,239	-	833,207,099	8,101,860
	カナダドル	49,642,608	-	50,147,224	504,616
	ユーロ	984,350,626	-	982,223,209	2,127,417
	英ポンド	168,188,799	-	168,877,529	688,730
	スイスフラン	8,544,478	-	8,550,340	5,862
	スウェーデンクローネ	20,044,328	-	19,894,671	149,657
	オーストラリアドル	34,492,947	-	35,264,735	771,788
	シンガポールドル	19,155,206	-	19,377,209	222,003
	合計	2,120,263,938	-	2,128,294,217	8,005,291

## (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相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

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相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 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相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

(2) 中間計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、中間計算期間末日の対顧客電信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。

## (1口当たり情報に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成26年 6月11日現在
-----	---------------------------

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4666円 (14,666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26年 6月11日現在
	金 額
資産の部	
流動資産	
親投資信託受益証券	500,998,664
流動資産合計	500,998,664
資産合計	500,998,664
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	269,177
未払委託者報酬	2,018,747
流動負債合計	2,287,924
負債合計	2,287,924
純資産の部	
元本等	
元本	216,477,985
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	282,232,755
(分配準備積立金)	163,195,110
元本等合計	498,710,740
純資産合計	498,710,740
負債純資産合計	500,998,664

## (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25年12月12日	至 平成26年 6月11日
	金 額	
営業収益		
有価証券売買等損益		17,746,972
営業収益合計		17,746,972
営業費用		
受託者報酬		269,177
委託者報酬		2,018,747
営業費用合計		2,287,924
営業利益又は営業損失( )		15,459,048
経常利益又は経常損失( )		15,459,048
中間純利益又は中間純損失( )		15,459,048
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は		712,026
一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )		
期首剰余金又は期首欠損金( )		294,119,125
剰余金増加額又は欠損金減少額		10,548,506
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		10,548,506
剰余金減少額又は欠損金増加額		37,181,898
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		37,181,898
中間剰余金又は中間欠損金( )		282,232,755

## (3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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。
-----------------	--

## (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26年 6月11日現在
1. 期首元本額	238,132,563円
期中追加設定元本額	8,451,501円
期中一部解約元本額	30,106,079円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	216,477,985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25年12月12日 至 平成26年 6月11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26年 6月11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	<p>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。</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>
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26年 6月11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26年 6月11日現在
該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成26年 6月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.3037円 (23,037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26年 6月11日現在	
	金 額	
資産の部		
流動資産		
預金		178,360,362
コール・ローン		244,121,384
国債証券		5,832,544,394
地方債証券		353,113,147
特殊債券		1,483,167,834
社債券		1,760,468,513
派生商品評価勘定		43,011,248
未収入金		2,344
未収利息		98,404,884
前払費用		21,288,683
差入委託証拠金		212,878,193
流動資産合計		10,227,360,986
資産合計		10,227,360,986
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		42,295,109
前受収益		49,243
未払金		10,233,822
未払解約金		5,946,559
その他未払費用		1,325,111
流動負債合計		59,849,844
負債合計		59,849,844
純資産の部		
元本等		
元本		3,605,608,304
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		6,561,902,838
元本等合計		10,167,511,142
純資産合計		10,167,511,142
負債純資産合計		10,227,360,986

(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25年12月11日及び平成26年6月11日における同親投資信託の状況であります。

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>
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発表されている対顧客先物相場の仲値によっております。</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</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>
----------------------------	---

## (貸借対照表に関する注記)

平成26年 6月11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	4,079,088,064円
期中追加設定元本額	161,186,443円
期中一部解約元本額	634,666,203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)	749,544,985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)	177,665,401円
ラッセル 外国債券ファンド - 2 (適格機関投資家限定)	1,803,140,036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)	521,331,212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)	139,919,555円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド 安定型	54,631,419円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド 安定・成長型	121,835,674円
ラッセル グローバル・バランス・ファンド 成長型	37,540,022円
計	3,605,608,304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	
	3,605,608,304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26年 6月11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</p> <p>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</p> <p>「（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</p> <p>「（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26年 6月11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26年 6月11日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,710,885,937	-	1,720,928,457	10,042,520
	売建	1,961,250,473	-	1,966,610,079	5,359,606
合計		3,672,136,410	-	3,687,538,536	4,682,914

## (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。

## 金利関連(平成26年 6月11日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	金利先物取引				
	買建	5,414,288,064	-	5,420,255,509	5,967,445
	売建	2,416,616,182	2,416,616,182	2,417,721,096	1,104,914
合計		7,830,904,246	2,416,616,182	7,837,976,605	4,862,531

## (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26年6月11日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引 以外の取 引	為替予約取引				
	買建	4,772,909,824	-	4,772,892,040	17,784
	米ドル	3,492,081,753	-	3,495,633,816	3,552,063
	カナダドル	71,794,145	-	72,027,890	233,745
	ユーロ	35,311,220	-	34,956,047	355,173
	英ポンド	748,735,311	-	747,750,928	984,383
	スイスフラン	43,260,358	-	42,413,830	846,528
	スウェーデンクローネ	89,478,029	-	88,605,360	872,669
	ノルウェークローネ	116,894,182	-	116,934,309	40,127
	デンマーククローネ	36,856,748	-	36,062,080	794,668
	ポーランドズロチ	57,930,986	-	57,774,800	156,186
	シンガポールドル	49,354,603	-	49,885,156	530,553
	南アフリカランド	31,212,489	-	30,847,824	364,665
	売建	4,570,709,400	-	4,579,520,922	8,811,522
	米ドル	1,363,624,898	-	1,364,586,348	961,450
	カナダドル	6,502,400	-	6,571,600	69,200
	メキシコペソ	377,430,799	-	373,941,552	3,489,247
	ユーロ	604,012,273	-	602,762,294	1,249,979
	英ポンド	432,210,455	-	431,180,214	1,030,241
	スイスフラン	37,610,100	-	37,524,300	85,800
	ノルウェークローネ	56,118,110	-	55,499,280	618,830
	ポーランドズロチ	21,909,292	-	22,027,614	118,322
	オーストラリアドル	1,032,168,112	-	1,046,873,275	14,705,163
	ニュージーランドドル	570,474,221	-	571,247,136	772,915
	シンガポールドル	24,851,168	-	24,948,672	97,504
	南アフリカランド	43,797,572	-	42,358,637	1,438,935
	合計	9,343,619,224	-	9,352,412,962	8,829,306

## (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相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

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相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算しております。
- ・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相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- (2) 開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客電信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。

(1口当たり情報に関する注記)

区 分	平成26年 6月11日現在
1口当たり純資産額	2.8199円
(1万口当たり純資産額)	(28,199円)

[前へ](#)

#### 4【委託会社等の概況】

##### (1)【資本金の額】

平成26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)【事業の内容及び営業の状況】

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

平成26年6月30日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。(親投資信託を除きます。)

商品分類	本数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	498	7,131,153
追加型公社債投資信託	18	712,449
単位型株式投資信託	23	411,807
単位型公社債投資信託	5	188,177
合計	544	8,443,585

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

##### (3)【その他】

該当事項はありません。



## 5【委託会社等の経理状況】

### （１）財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱UFJ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。）に基づいて作成しております。

なお、当事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表に含まれる比較情報については、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成24年9月21日内閣府令第61号）附則第2条第2項により、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

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29期事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第28期 (平成25年3月31日現在)		第29期 (平成26年3月31日現在)	
<b>(資産の部)</b>				
<b>流動資産</b>				
現金及び預金	2	22,261,065	2	33,576,940
有価証券	2	8,000,000		120,983
前払費用		159,117		166,599
未収入金		5,504		168,410
未収委託者報酬		4,489,181		6,895,748
未収収益	2	47,936	2	64,325
繰延税金資産		402,791		399,128
金銭の信託	2	30,000	2	30,000
その他		39,167		111,434
流動資産合計		35,434,764		41,533,570
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
建物	1	270,058	1	254,682
器具備品	1	171,754	1	178,962
土地		1,205,031		1,205,031
有形固定資産合計		1,646,844		1,638,676
<b>無形固定資産</b>				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		857,424		1,147,522
ソフトウェア仮勘定		430,432		105,254
無形固定資産合計		1,303,679		1,268,599
<b>投資その他の資産</b>				
投資有価証券		15,689,317		19,370,921
関係会社株式		320,136		320,136
長期性預金	2	3,500,000		
長期差入保証金	2	825,804	2	813,838
その他		15,035		15,035
投資その他の資産合計		20,350,294		20,519,931
固定資産合計		23,300,818		23,427,207
資産合計		58,735,583		64,960,778

(単位：千円)

	第28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
<b>(負債の部)</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	75,221	270,374
未払金		
未払収益分配金	33,936	62,872
未払償還金	1,004,879	927,297
未払手数料	2 1,761,746	2 2,914,613
その他未払金	84,763	56,199
未払費用	2 1,333,574	2 1,623,932
未払消費税等	128,077	266,187
未払法人税等	1,686,070	2,228,949
賞与引当金	594,000	585,962
その他	348,389	383,684
流動負債合計	7,050,661	9,320,074
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	119,776	154,690
役員退職慰労引当金	65,103	63,000
時効後支払損引当金	201,877	226,128
繰延税金負債	251,776	253,904
固定負債合計	638,533	697,725
負債合計	7,689,194	10,017,799
<b>(純資産の部)</b>		
<b>株主資本</b>		
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	39,686,216	43,710,993
利益剰余金合計	47,026,806	51,051,583
株主資本合計	49,249,033	53,273,811

(単位：千円)

	第28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
評価・換算差額等		
その他有価証券 評価差額金	1,797,355	1,669,167
評価・換算差額等合計	1,797,355	1,669,167
純資産合計	51,046,388	54,942,978
負債純資産合計	58,735,583	64,960,778

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第28期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		第29期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		48,411,166		53,423,757
投資顧問料		13,601		139,837
その他営業収益		138,788		99,673
営業収益合計		48,563,556		53,663,268
営業費用				
支払手数料	2	19,724,426	2	21,905,982
広告宣伝費		543,508		694,552
公告費		1,748		1,062
調査費				
調査費		942,478		977,602
委託調査費		10,699,987		11,329,088
事務委託費		242,537		263,721
営業雑経費				
通信費		89,308		97,901
印刷費		443,177		510,065
協会費		39,963		40,060
諸会費		7,621		7,806
事務機器関連費		971,457		1,041,363
その他営業雑経費		8,989		12,477
営業費用合計		33,715,204		36,881,683
一般管理費				
給料				
役員報酬		198,915		205,947
給料・手当		3,740,875		3,814,639
賞与引当金繰入		594,000		585,962
福利厚生費		593,073		603,032
交際費		23,259		21,433
旅費交通費		139,968		143,037
租税公課		115,450		123,549
不動産賃借料		699,860		692,573
退職給付費用		162,650		256,292
役員退職慰労引当金繰入		19,007		20,252
固定資産減価償却費		442,844		467,545
諸経費		270,874		300,280
一般管理費合計		7,000,782		7,234,545
営業利益		7,847,569		9,547,039

(単位：千円)

	第28期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		第29期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		213,088		287,886
有価証券利息	2	6,698	2	3,249
受取利息	2	25,684	2	19,503
投資有価証券償還益		6,072		1,862
収益分配金等時効完成分		412,323		64,449
その他		1,935		2,886
営業外収益合計		665,802		379,836
営業外費用				
投資有価証券償還損		8,689		57
時効後支払損引当金繰入		16,881		49,112
事務過誤費		186		1,389
その他		45		4,097
営業外費用合計		25,802		54,656
経常利益		8,487,569		9,872,219
特別利益				
投資有価証券売却益		334,775		767,140
特別利益合計		334,775		767,140
特別損失				
投資有価証券売却損		32,155		49,266
固定資産除却損	1	253	1	466
特別損失合計		32,409		49,732
税引前当期純利益		8,789,934		10,589,626
法人税、住民税及び事業税		3,441,310		3,847,871
法人税等調整額		55,499		11,641
法人税等合計		3,385,811		3,859,512
当期純利益		5,404,123		6,730,113

## (3)【株主資本等変動計算書】

第28期（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日 ）

(単位：千円)

	株主資本							株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	資本剰余金合計		その他利益剰余金			
					別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,131	222,096	222,096	342,589	6,998,000	36,863,331	44,203,921	46,426,148
当期変動額								
剰余金の配当						2,581,238	2,581,238	2,581,238
当期純利益						5,404,123	5,404,123	5,404,123
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）								
当期変動額合計						2,822,884	2,822,884	2,822,884
当期末残高	2,000,131	222,096	222,096	342,589	6,998,000	39,686,216	47,026,806	49,249,033

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	723,054	723,054	47,149,203
当期変動額			
剰余金の配当			2,581,238
当期純利益			5,404,123
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,074,300	1,074,300	1,074,300
当期変動額合計	1,074,300	1,074,300	3,897,185
当期末残高	1,797,355	1,797,355	51,046,388

第29期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日 )

(単位:千円)

	株主資本							株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	資本剰余金合計		その他利益剰余金			
					別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,131	222,096	222,096	342,589	6,998,000	39,686,216	47,026,806	49,249,033
当期変動額								
剰余金の配当						2,705,336	2,705,336	2,705,336
当期純利益						6,730,113	6,730,113	6,730,113
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)								
当期変動額合計						4,024,777	4,024,777	4,024,777
当期末残高	2,000,131	222,096	222,096	342,589	6,998,000	43,710,993	51,051,583	53,273,811

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,797,355	1,797,355	51,046,388
当期変動額			
剰余金の配当			2,705,336
当期純利益			6,730,113
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	128,187	128,187	128,187
当期変動額合計	128,187	128,187	3,896,589
当期末残高	1,669,167	1,669,167	54,942,978



## [注記事項]

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1)子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

## (2)その他有価証券

## 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)を採用しております。

## 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 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. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

## 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。

## 退職給付見込額の期間帰属方法

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

## 数理計算上の差異の費用処理方法

数理計算上の差異は、その発生年度の翌事業年度より一括費用処理することとしております。

## (会計上の見積もりの変更)

数理計算上の差異は、従来、発生年度の従業員の平均支払期間内の一定の年数(8年)により費用処理していましたが、当事業年度において、平均支払期間が8年を下回ったことから、数理計算上の差異を一括費用処理する方法に見直し、将来にわたり変更しております。

これにより、従来の方法と比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税金等調整前当期純利益はそれぞれ87百万円減少しております。

## (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

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

## (未適用の会計基準等)

「退職給付に関する会計基準」(企業会計基準第26号 平成24年5月17日)及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日)

## (1) 概要

未認識数理計算上の差異及び未認識過去勤務費用の処理方法、退職給付債務及び勤務費用の計算方法並びに開示の拡充等について改正されました。

## (2) 適用予定日

退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正については、平成27年3月期の期首から適用します。なお、当該会計基準等には経過的な取り扱いが定められているため、過去の期間の財務諸表に対しては遡及適用しません。

## (3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等を適用することにより、翌事業年度の期首の繰延税金資産は4,225千円増加し、退職給付引当金は11,857千円増加し、繰越利益剰余金は7,631千円減少しております。

## (貸借対照表関係)

## 1.有形固定資産の減価償却累計額

	第28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
建物	233,990千円	258,119千円
器具備品	351,481千円	374,405千円

## 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28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
預金	19,410,015千円	30,782,482千円
有価証券	8,000,000千円	-
未収収益	40,120千円	34,750千円
金銭の信託	30,000千円	30,000千円
長期性預金	3,500,000千円	-
長期差入保証金	816,823千円	804,456千円
未払手数料	927,107千円	1,802,448千円
未払費用	148,712千円	171,067千円

## (損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

	第28期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第29期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
器具備品	253千円	466千円
計	253千円	466千円

## 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28期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第29期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
支払手数料	10,230,968千円	11,642,746千円
有価証券利息	5,170千円	2,051千円
受取利息	25,684千円	19,503千円

## (株主資本等変動計算書関係)

第28期（自 平成24年4月1日 至 平成25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
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

## (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25年6月24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	2,705,336千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	21,800円
基準日	平成25年3月31日
効力発生日	平成25年6月25日

第29期（自平成25年4月1日至平成26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25年6月24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	2,705,336千円
1株当たり配当額	21,800円
基準日	平成25年3月31日
効力発生日	平成25年6月25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26年6月27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	3,375,465千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	27,200円
基準日	平成26年3月31日
効力発生日	平成26年6月30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28期（平成25年3月31日現在）

	貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 現金及び預金	22,261,065	22,261,065	-
(2) 有価証券	8,000,000	8,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	4,489,181	4,489,181	-
(4) 長期性預金	3,500,000	3,505,795	5,795
(5) 投資有価証券	15,650,417	15,650,417	-
資産計	53,900,663	53,906,459	5,795
(1) 未払手数料	1,761,746	1,761,746	-
(2) 未払法人税等	1,686,070	1,686,070	-
負債計	3,447,816	3,447,816	-

## 第29期（平成26年3月31日現在）

	貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 現金及び預金	33,576,940	33,576,940	-
(2) 有価証券	120,983	120,983	-
(3) 未収委託者報酬	6,895,748	6,895,748	-
(4) 長期性預金	-	-	-
(5) 投資有価証券	19,332,021	19,332,021	-
資産計	59,925,694	59,925,694	-
(1) 未払手数料	2,914,613	2,914,613	-
(2) 未払法人税等	2,228,949	2,228,949	-
負債計	5,143,563	5,143,563	-

## （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。

## (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28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
非上場株式	38,900	38,900
子会社株式	160,600	160,600
関連会社株式	159,536	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28期(平成25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	22,261,065	-	-	-
未収委託者報酬	4,489,181	-	-	-
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	-	4,150,204	2,167,462	2,151,428
長期性預金	-	3,500,000	-	-
合計	34,750,246	7,650,204	2,167,462	2,151,428

第29期(平成26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	33,576,940	-	-	-
未収委託者報酬	6,895,748	-	-	-
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	-	-	-	-
投資信託	120,983	3,103,140	6,128,025	1,408,595
長期性預金	-	-	-	-
合計	40,593,672	3,103,140	6,128,025	1,408,595

## (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160,600千円、関連会社株式159,536千円)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28期(平成25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	12,625,086	10,181,990	2,443,096
	小計	12,625,086	10,181,990	2,443,096
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	3,025,331	3,033,767	8,436
	小計	3,025,331	3,033,767	8,436
合計		15,650,417	13,215,757	2,434,660

第29期(平成26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	16,263,940	13,940,367	2,323,572
	小計	16,263,940	13,940,367	2,323,572
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	3,189,065	3,212,015	22,950
	小計	3,189,065	3,212,015	22,950
合計		19,453,005	17,152,382	2,300,622

## 3. 売却したその他有価証券

第28期(自平成24年4月1日至平成25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	7,033,368	334,775	32,155
合計	7,033,368	334,775	32,155

第29期(自平成25年4月1日至平成26年3月31日)

種類	売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他	3,836,955	767,140	49,266
合計	3,836,955	767,140	49,266

(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)

第28期(自平成24年4月1日至平成25年3月31日)

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。

2.退職給付債務に関する事項

(1) 退職給付債務(千円)	382,988
(2) 年金資産(千円)	143,462
(3) 未積立退職給付債務 (1)+(2)(千円)	239,525
(4) 未認識数理計算上の差異(千円)	119,749
(5) 貸借対照表計上額純額 (3)+(4)(千円)	119,776
(6) 退職給付引当金(千円)	119,776

3.退職給付費用に関する事項

(1) 勤務費用(千円)	26,748
(2) 利息費用(千円)	7,087
(3) 期待運用収益(千円)	2,984
(4) 数理計算上の差異の費用処理額(千円)	27,653
(5) その他(千円)	104,146
(6) 退職給付費用(1)+(2)+(3)+(4)+(5)(千円)	162,650

(注)「(5)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

1.5%

(3)期待運用収益率

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。)



第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

## 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。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	382,988千円
勤務費用	425
利息費用	5,724
数理計算上の差異の発生額	432
退職給付の支払額	75,066
<u>退職給付債務の期末残高</u>	<u>313,639</u>

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	143,462千円
期待運用収益	2,151
数理計算上の差異の発生額	3,824
事業主からの拠出額	88,833
退職給付の支払額	75,066
<u>年金資産の期末残高</u>	<u>163,205</u>

## (3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

積立型制度の退職給付債務	311,889千円
年金資産	163,205
	<u>148,683</u>
非積立型制度の退職給付債務	1,750
未認識数理計算上の差異	4,257
<u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u>	<u>154,690</u>
退職給付引当金	154,690
<u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u>	<u>154,690</u>

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	425千円
利息費用	5,724
期待運用収益	2,151
数理計算上の差異の費用処理額	119,749
その他	25,147
<u>確定給付制度に係る退職給付費用</u>	<u>148,895</u>

（注）「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額です。

## (5)年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

債券	31.1%
株式	13.1
その他	55.8
合計	100

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6)数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 1.5%

長期期待運用収益率 1.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は107,397千円でありました。

## (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28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	542,460 千円	527,037 千円
投資有価証券評価損	226,404	42,394
ゴルフ会員権評価損	8,505	8,505
未払事業税	140,336	154,726
賞与引当金	225,779	208,836
役員退職慰労引当金	23,202	22,453
退職給付引当金	45,495	55,131
減価償却超過額	10,083	10,659
委託者報酬	124,166	136,745
長期差入保証金	26,203	30,510
時効後支払損引当金	71,948	80,592
その他	48,666	41,232
繰延税金資産 小計	1,493,253	1,318,825
評価性引当額	704,932	542,145
繰延税金資産 合計	788,320	776,680
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	637,305	631,455
その他	-	1
繰延税金負債 合計	637,305	631,456
繰延税金資産の純額	151,015	145,223

## 2. 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

「所得税法等の一部を改正する法律」が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、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、前事業年度の38.01%から35.64%に変更されております。

その結果、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)が29,724千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が29,724千円増加しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第28期（自平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）及び第29期（自平成25年4月1日 至 平成26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28期（自平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）及び第29期（自平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

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28期（自平成24年4月1日至平成25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	4,556,241 千円	未払手数料	324,725 千円	
							事務所の賃借	事務所賃借料	671,086 千円	長期差入保証金	812,027 千円
							投資の助言	投資助言料	167,142 千円	未払費用	85,301 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	5,674,726 千円	未払手数料	602,382 千円	
							取引銀行	譲渡性預金の預入	30,000,000 千円	有価証券	8,000,000 千円
								譲渡性預金に係る受取利息	5,170 千円	未収収益	717 千円
								マルチコーラブル預金の預入	5,500,000 千円	現金及び預金	10,500,000 千円
										長期性預金	3,500,000 千円
			マルチコーラブル預金に係る受取利息	24,246 千円	未収収益	2,301 千円					

## 第29期(自平成25年4月1日至平成26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	4,507,475 千円	未払手数料	476,882 千円
						事務所の賃借	事務所賃借料	671,086 千円	長期差入保証金	799,941 千円
						投資の助言	投資助言料	190,144 千円	未払費用	99,131 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	7,135,270 千円	未払手数料	1,325,565 千円
						取引銀行	譲渡性預金の預入	14,000,000 千円		
							譲渡性預金に係る受取利息	2,051 千円		
							マルチコーラブル預金の預入	6,500,000 千円	現金及び預金	10,000,000 千円
							マルチコーラブル預金に係る受取利息	16,775 千円	未収収益	646 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、市場実勢を勘案して決定しております。

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

上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等  
第28期(自平成24年4月1日至平成25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	3,513,173 千円	未払手数料	321,822 千円

## 第29期(自平成25年4月1日至平成26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	3,638,642 千円	未払手数料	544,991 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28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	411,339.33円	442,738.63円
1株当たり当期純利益金額	43,547.22円	54,232.25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28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
当期純利益金額 (千円)	5,404,123	6,730,113
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)	5,404,123	6,730,113
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。



# 独立監査人の中間監査報告書

平成26年7月23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 柴 毅 印  
業務執行社員指定社員 公認会計士 和田 渉 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25年12月13日から平成26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26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25年12月13日から平成26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26年7月23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 柴 毅 印  
業務執行社員指定社員 公認会計士 和田 渉 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25年12月13日から平成26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26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25年12月13日から平成26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26年7月23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 柴 毅 印  
業務執行社員指定社員 公認会計士 和田 渉 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25年12月13日から平成26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26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25年12月13日から平成26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26年6月27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	樋口 誠之	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25年4月1日から平成26年3月31日までの第29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26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](#)