

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書
【提出先】 関東財務局長
【提出日】 平成28年11月14日
【計算期間】 第15期（自 平成27年 8 月15日 至 平成28年 8 月15日）
【ファンド名】 三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（安定成長型）
【発行者名】 三菱UFJ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】 取締役社長 松田 通
【本店の所在の場所】 東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】 伊藤 晃
【連絡場所】 東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【電話番号】 03-6250-4740
【縦覧に供する場所】 該当ありません

【提出書類】 募集事項等記載書面
【提出先】 関東財務局長
【提出日】 平成28年11月14日
【発行者名】 三菱UFJ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】 取締役社長 松田 通
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（安定成長型）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 継続募集額 上限1兆円
【縦覧に供する場所】 該当ありません

（注）金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第5条第12項の規定により、募集事項等記載書面を有価証券報告書と併せて提出することにより、有価証券届出書を提出したものとみなされます。

【証券情報】**(1) 【ファンドの名称】**

三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定成長型)(「ファンド」といいます。)

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託です。

当初元本は1口当たり1円です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律(「社振法」といいます。)の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関(社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます。)の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります(振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(3) 【発行(売出)価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

(略称：Dラ安成)

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034(受付時間：毎営業日の9:00~17:00)

ホームページアドレス <http://www.am.mufg.jp/>

(注)基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。

なお、当ファンドでは1万口当たりの価額で表示されます。

毎営業日とは、土曜日、日曜日、「国民の祝日に関する法律」に定める休日ならびに12月31日、1月2日および1月3日以外の日とします。以下、同じ。

(5) 【申込手数料】

申込手数料はかかりません。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位

再投資される収益分配金については1口単位とします。

(7) 【申込期間】

平成28年11月15日から平成29年11月13日までです。

(注)上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、確定拠出年金制度を利用する場合の申込みに限り取り扱うものとします。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034(受付時間：毎営業日の9:00~17:00)

(9) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

払込期日は販売会社により異なる場合がありますので、販売会社にご確認ください。

振替受益権に係る各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を經由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社とします。

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権の振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、振替機関の振替業に係る業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。ファンドの分配金、償還金、解約代金は、社振法および振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(12) 【その他】

該当事項はありません。

【有価証券報告書】

第一部【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】

当ファンドは、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、5,000億円です。

当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
	海外	債券	MRF	
追加型	内外	不動産投信	ETF	特殊型 ()
		その他資産 ()		
		資産複合		

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式	年1回	グローバル	ファミリー	あり	日経225	ブル・ベア型
一般	年2回	(日本を含む)	ファンド	()	TOPIX	条件付運用型
大型株	年4回	日本	ファンド・	なし		
中小型株	年6回	北米			オブ・	
債券	(隔月)	欧州	ファンズ		その他	ロング・
一般	年12回	アジア			()	ショート型/ 絶対収益 追求型
公債	(毎月)	オセアニア				その他 ()
社債	日々	中南米				
その他債券	その他	アフリカ				
クレジット	()	中近東				
属性		(中東)				
()		エマージング				
不動産投信						
その他資産						
(投資信託証券						
(資産複合(株						
式、債券))						
資産複合						
()						

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

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せん。

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。
	MRF（マネー・リザーブ・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMRFをいいます。
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	特殊型	信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

属性区分の定義

投資対象 資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（BBB格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（BB格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。	
	その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。	
資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。		
決算頻度	年1回	信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年2回	信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年4回	信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年6回（隔月）	信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年12回（毎月）	信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。	
	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。	
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。	

投資対象地域	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経225	信託約款において、日経225に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	TOPIX	信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型 / 絶対収益追求型	信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

内外の株式・債券を実質的な主要投資対象とし、各資産の指数を合成した指数をベンチマークとして、超過収益を積み上げることをめざします。

ファンドの特色

特色 1

主として、国内債券マザーファンド、国内株式マザーファンド、世界債券マザーファンドおよび世界株式マザーファンドへの投資を通して、国内債券・国内株式・外国債券・外国株式への分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ長期的に安定した収益の積上げをめざします。

特色 2

委託会社が独自に指数化する合成インデックスをベンチマーク^(注1)として、超過収益を積み上げることを図ります。

委託会社が独自に指数化する合成インデックスとは、NOMURA-BPI総合インデックス^(注2)42%、東証株価指数(TOPIX)^(注3)30%、シティ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)^(注4)10%、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)^(注5)15%、無担保コール翌日物レート(短資協会発表)の平均値3%を合成したものです。

(注1)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。

(注2)NOMURA-BPI総合インデックスとは、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総合インデックスは野村証券株式会社の知的財産であり、当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。

(注3)東証株価指数(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で、わが国の株式市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。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、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止または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。

(注4)シティ世界国債インデックス(除く日本)は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。シティ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)とは、シティ世界国債インデックス(除く日本)をもとに、委託会社が計算したものです。

(注5)MSCI Kokusai Index(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、日本を除く世界の先進国で構成されています。

MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)は、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(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 Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)に対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

特色3

国内債券、国内株式、外国債券、および外国株式に投資するそれぞれのマザーファンドを設定し、その運用にはベンチマークを定め、アクティブ運用により、これを上回る収益を追求します。

マザーファンドの基本方針は以下の通りです。

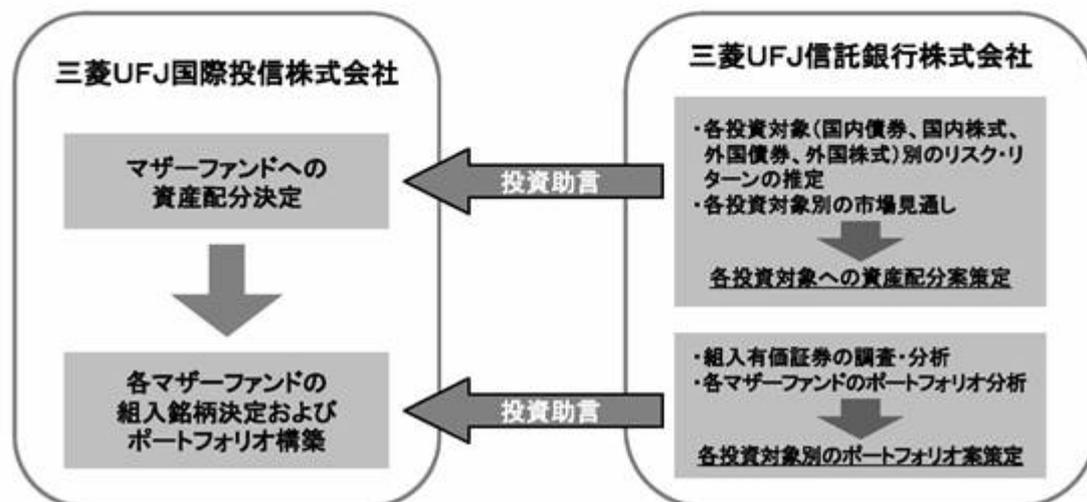
ファンド名	基本方針
国内債券マザーファンド	国内の債券を主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合インデックスを上回る投資成果をめざします。
国内株式マザーファンド	国内の株式を主要投資対象とし、東証株価指数(TOPIX)を上回る投資成果をめざします。
世界債券マザーファンド	外国の債券を主要投資対象とし、シティ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)を上回る投資成果をめざします。
世界株式マザーファンド	外国の株式を主要投資対象とし、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)を上回る投資成果をめざします。

実質的な組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。そのため、為替相場の変動による影響を受けます。

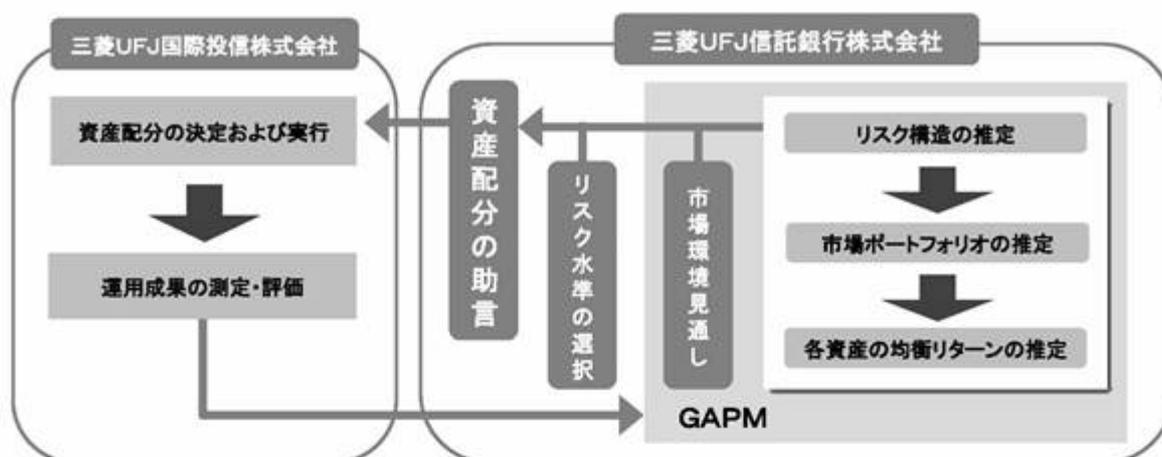
特色4

資産配分および各マザーファンドのポートフォリオ構築にあたりましては、三菱UFJ信託銀行株式会社からの投資助言を受けます。

※ 投資助言者、投資助言の内容、投資助言の有無等については、変更する場合があります。



ベビーファンドの資産配分助言のプロセス



GAPM

GAPM(Global Asset Pricing Model)とは、市場均衡理論にその基礎を置く資本資産評価モデル(CAPM=Capital Asset Pricing Model)をグローバルに展開した、リスク・リターンの推計モデルです。

「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ(<http://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)でご覧いただけます。

■ファンドの仕組み

運用は主に各マザーファンドへの投資を通じて、内外の株式・債券へ実質的に投資するファミリーファンド方式により行います。



■主な投資制限

- ・株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の60%未満とします。
- ・同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の40%未満とします。
- ・デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。

■分配方針

- ・年1回の決算時(8月14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。

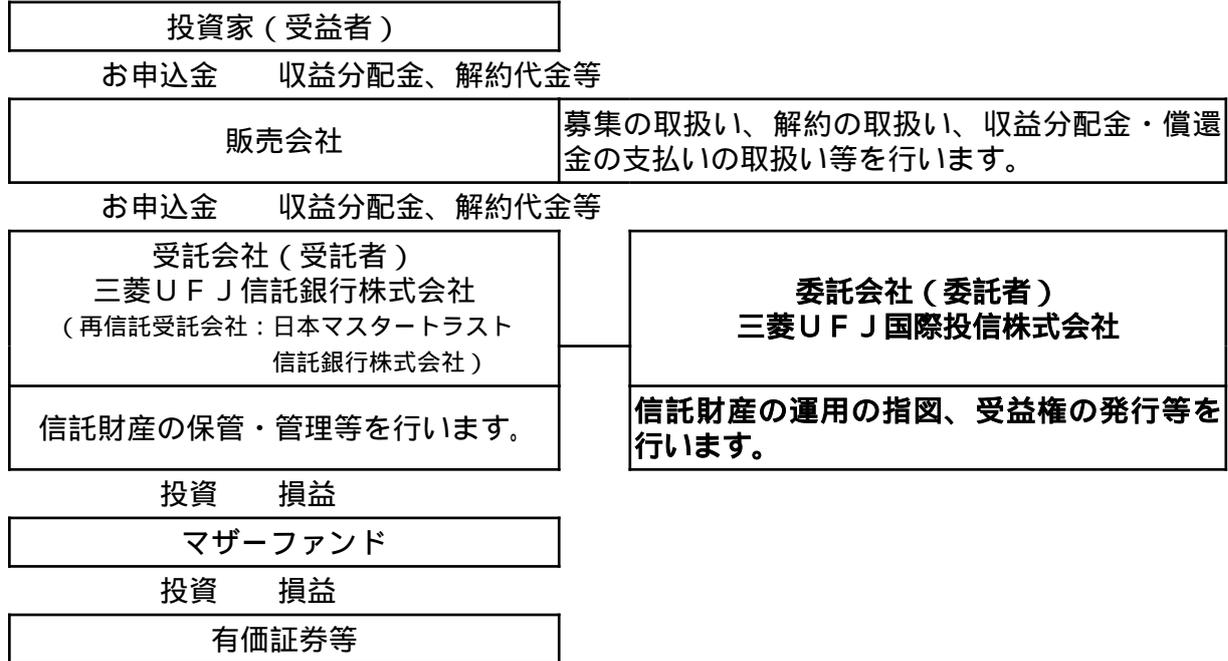
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

平成13年10月18日	設定日、信託契約締結、運用開始
平成17年10月1日	ファンドの委託会社としての業務をユーエフジェイパートナーズ投信株式会社から三菱UFJ投信株式会社に承継 名称を「UFJパートナーズ<DC>ライフ・バランスファンド（安定成長型）」から「三菱UFJ<DC>ライフ・バランスファンド（安定成長型）」に変更

(3) 【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割



委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「募集・販売の取扱い等に関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。

委託会社の概況

- ・ 資本金
2,000百万円（平成28年8月末現在）
- ・ 沿革

平成9年5月	東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
平成16年10月	東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
平成17年10月	三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更

平成27年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を
三菱UFJ国際投信株式会社に変更

・大株主の状況(平成28年8月末現在)

株主名	住所	所有株式数	所有比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	107,855株	51.0%
三菱UFJ証券ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内二丁目5番2号	71,969株	34.0%
株式会社三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	31,757株	15.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

国内債券マザーファンド受益証券、国内株式マザーファンド受益証券、世界債券マザーファンド受益証券および世界株式マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか内外の株式・公社債に直接投資することがあります。

主として、国内債券マザーファンド受益証券、国内株式マザーファンド受益証券、世界債券マザーファンド受益証券および世界株式マザーファンド受益証券への投資を通して、国内債券・国内株式・外国債券・外国株式への分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ長期的に安定した収益の積上げをめざします。

国内債券42%、国内株式30%、外国債券10%、外国株式15%および短期金融商品3%の比率で配分した基本ポートフォリオのもと、個別資産毎におけるアクティブ運用を行い、委託会社が独自に指数化する合成インデックスをベンチマークとして超過収益を積み上げることを図ります。

(注)委託会社が独自に指数化する合成インデックスとは、NOMURA-BPI総合インデックス42%、東証株価指数(TOPIX)30%、シティ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)10%、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイインデックス)(円換算ベース)15%、無担保コール翌日物レート(短資協会発表)の平均値3%を合成したものです。

各資産につき、基本ポートフォリオにおける各資産毎の比率から±5%以内の範囲に配分比率の変動を抑えます。ただし、市況動向等に応じて、基本ポートフォリオは適宜見直しを行います。

実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、

運用効率の向上を図るため、エクスポージャー^(注)のコントロールを行う場合があります。

株式以外の資産への実質投資割合(信託財産に属する株式以外の資産の時価総額と信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の総額に占める株式以外の資産の時価総額の割合を乗じて得た額との合計額が信託財産の総額に占める割合)は、原則として信託財産の総額の75%以下とします。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(注)エクスポージャーとは、金融資産のうち市場の価格変動リスク・為替変動リスクにさらしている資産の度合いのことをいいます。

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1.次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)

イ.有価証券

ロ.デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款に定める次のものに限り、)

a.有価証券先物取引等

b.スワップ取引

c.金利先渡取引および為替先渡取引

ハ.約束手形

ニ.金銭債権

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)は、三菱UFJ国際投信株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社とする国内債券マザーファンド、国内株式マザーファンド、世界債券マザーファンド、世界株式マザーファンドおよび短期資産マザーファンド(「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。)の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 資産の流動化に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。)
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から12. の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16. において同じ。))で16. で定めるもの以外のもの
16. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16. において同じ。))または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
17. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
18. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
19. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
22. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
24. 外国の者に対する権利で23. の有価証券の性質を有するもの

なお、1. の証券または証書ならびに13. および19. の証券または証書のうち1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から6. までの証券ならびに16. の証券ならびに13. および19. の証券または証書のうち2. から6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14. および15. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

この信託において投資の対象とする金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)は、次に掲げるものとします。

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。)

3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの
- その他の投資対象
信託約款に定める次に掲げるもの。
- ・外国為替予約取引

< マザーファンドの概要 >

国内債券マザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、長期的に信託財産の成長を目標として運用を行います。

(運用方法)

投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

わが国の公社債を主要投資対象とします。

金利予測に基づき、デュレーション^(注)のリスクをベンチマーク（NOMURA - BPI総合インデックス）に対して限定的に取りつつ、残存期間構成・種別構成の変更を行うことにより、長期・安定的にベンチマークを上回る投資成果をめざします。

ポートフォリオ構築は以下のプロセスで行います。

1. マクロ経済・市場環境等の分析に基づき、デュレーション・残存期間構成・種別構成等を決定します。
2. デュレーションについては、ベンチマーク比 $\pm 25\%$ 程度の範囲内で、コントロールします。
3. 残存期間構成については、ヒストリカルデータ分析とマクロ経済・市場環境等の分析における見通しから、割高割安を判定し決定します。
4. セクター配分は、ヒストリカルデータ分析に、信用リスク・流動性・投資家動向等の分析を加味して決定します。

金融債、事業債、円建外債への投資は、原則としてA格以上（S&P、ムーディーズ、格付投資情報センター、日本格付研究所の内の最高格付を採用）に限定しており、またセクター内においては一つの銘柄・業種に過度のウェイトをかけず、分散を図ります。

特定の銘柄や業種に対し、過度の集中がないように配慮します。

公社債組入比率は原則として100%に近い水準を維持します。ただし、市場動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(注) デュレーションとは、債券の投資元本の回収に要する平均残存期間や金利感応度を意味する指標です。この値が大きいほど、金利変動に対する債券価格の変動率が大きくなります。

(投資制限)

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

金利先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

国内株式マザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

(運用方法)

投資対象

わが国の金融商品取引所に上場されている株式および店頭登録株式を主要投資対象とします。

投資態度

わが国の金融商品取引所に上場されている株式および店頭登録株式を主要投資対象とします。

企業のファンダメンタルズ分析を重視したボトムアップによる銘柄選択を主軸としつつ、トップダウンによるリスク・コントロール（業種配分・ファクター戦略）を付加することにより、長期・安定的にベンチマーク（東証株価指数（TOPIX））を上回る投資成果をめざします。

ポートフォリオ構築は以下のプロセスで行います。

1. わが国の金融商品取引所上場銘柄および店頭登録銘柄を対象に成長性・安全性・流動性等を勘案した組入候補銘柄群を選定したうえで、利益成長性（業績モメンタム、中期成長性）、企業の定性評価（事業資質、経営資源、業界環境、企業戦略）、株価評価等を基準に組入銘柄・組入比率を決定し、ポートフォリオを構築します。
2. 構築されたポートフォリオについては、マクロ経済・金利・株式市場等の分析に基づくセクター配分、ファクター戦略を加味して、リスク・コントロールを図ります。

特定の銘柄や業種に対し、過度の集中がないように配慮します。

株式組入比率は原則として100%に近い水準を維持します。ただし、市場動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

世界債券マザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、長期的に信託財産の成長を目標として運用を行います。

（運用方法）

投資対象

日本を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

日本を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とします。

金利・為替予測に基づき、通貨別投資配分、デュレーション、残存期間構成のリスクをベンチマーク（シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース））に対して限定的に取ることで、長期・安定的にベンチマークを上回る投資成果をめざします。

ポートフォリオ構築は以下のプロセスで行います。

1. 各国のマクロ環境分析、市場動向分析に基づき、通貨別国別投資配分・デュレーション・残存期間構成等を決定します。
2. 国別通貨別投資配分、デュレーションについては通貨ブロック（ドル圏、欧州圏）別のデュレーション調整後ウェイトをベンチマーク比 $\pm 50\%$ 程度の範囲内とします。
3. 残存期間構成については、ヒストリカルデータ分析とマクロ経済・市況環境等の分析における見通しから、割高割安を判定し決定します。

原則としてA格以上（S&P、ムーディーズの内の最高格付を採用）の公社債等に限定しており、特定の銘柄に対し、過度の集中がないように配慮します。

公社債組入比率は原則として100%に近い水準を維持します。ただし、市場動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

外貨建資産については、原則としてヘッジは行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、エクスポージャーのコントロールを行う場合があります。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

世界株式マザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、長期的に信託財産の成長を目標として運用を行います。

（運用方法）

投資対象

日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。

投資態度

日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。

世界各国の経済動向、株式市場動向の分析を踏まえ北米・欧州・アジアの3地域の投資配分を決定し、その上でボトムアップによる銘柄選択を行います。リスク・コントロール（国別配分・ファクター分析・信用リスク）を付加することにより長期・安定的にベンチマーク（MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース））を上回る投資成果をめざします。

ポートフォリオ構築は以下のプロセスで行います。

1. MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）採用銘柄およびインデックス採用国の中で成長性に魅力があり信用リスク上問題の無い銘柄から約1,000銘柄を投資対象銘柄として選定します。
2. 政治・経済・金利・通貨動向等マクロの環境分析、株式市場分析に基づき北米・欧州・アジアの3地域の投資配分を決定します。
3. 投資対象銘柄群の中から、利益成長性（業績モメンタム、中期成長性）、企業の定性評価（事業資質、経営資源、業界環境、企業戦略）、株価評価等を基準に組入銘柄・組入比率を決定します。
4. 上記により構築されたポートフォリオについては、国別ウエイト、ファクター分析、トラッキングエラー、投資対象国・投資対象銘柄制度による信用リスク等のチェックによりリスク・コントロールを図ります。

特定の銘柄や業種、国に対し、過度の集中がないように配慮します。

株式組入比率は原則として100%に近い水準を維持します。ただし、市場動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、エクスポージャーのコントロールを行う場合があります。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。ただし、外国または外国の者の発行する株券等に限りません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

短期資産マザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、安定的な収益の確保を目標として運用を行います。

（運用方法）

投資対象

わが国の短期公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。

投資態度

わが国の短期公社債および短期金融商品に投資し、利子等収益の確保を図ります。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

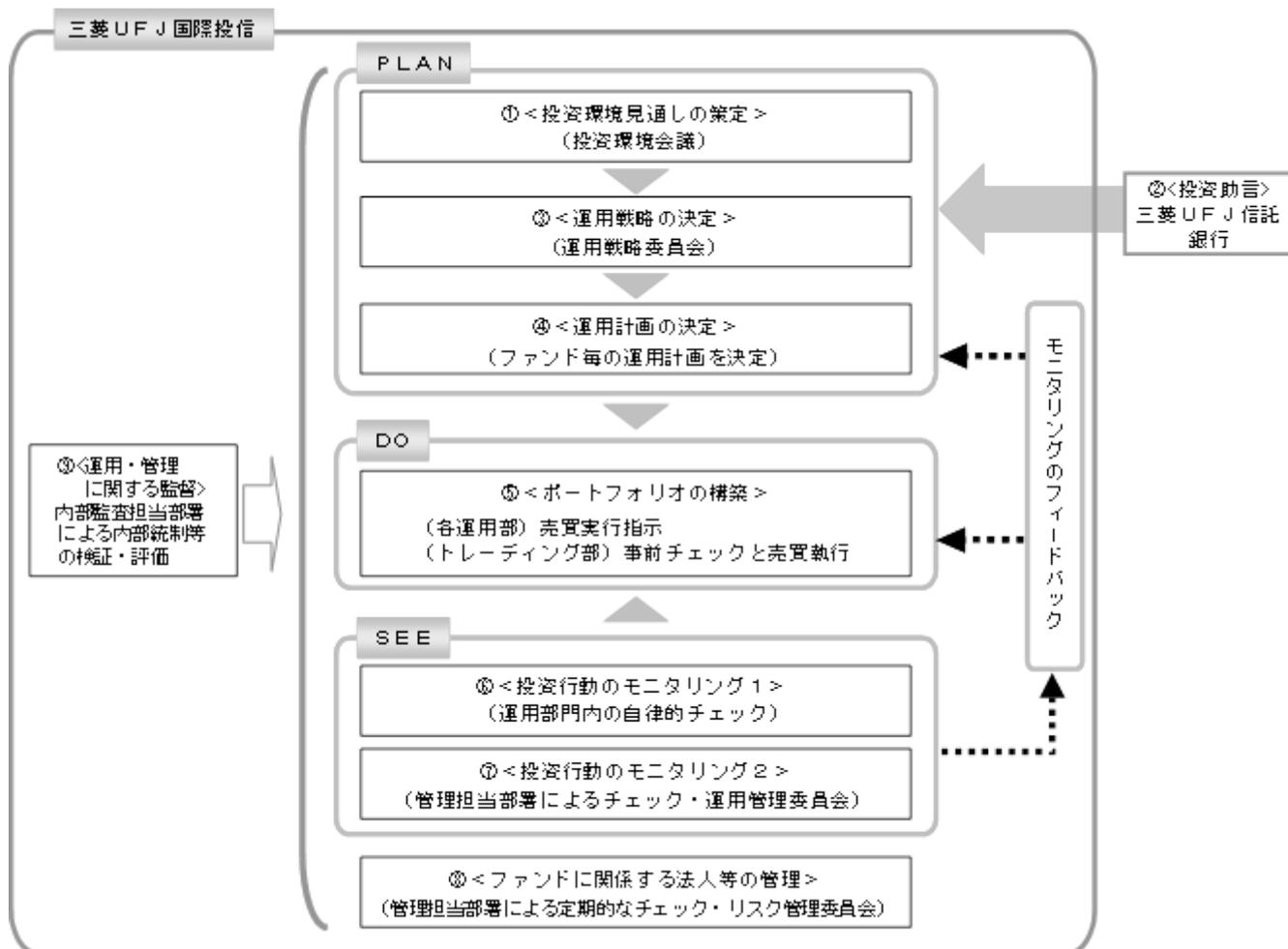
外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

金利先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

(3) 【運用体制】

**投資環境見通しの策定**

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

投資助言

当ファンドは、三菱UFJ信託銀行（「助言元」といいます。）から運用戦略または運用計画の立案に資する投資助言を受けています。

運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通し、およびの投資助言に沿って運用戦略を決定します。

運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部門から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

投資行動のモニタリング1

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

投資行動のモニタリング2

運用部門から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

ファンドに関係する法人等の管理

助言元、受託会社等、ファンドの運営に関係する法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果

は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されま
す。

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署(10名程度)は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全
性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性
を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報
告される、内部監査態勢が構築されています。

さらに、委託会社は、三菱UFJ信託銀行からの投資環境および全資産に関する助言を活用して、
質の高い運用サービスの提供に努めています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

(4)【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額としま
す。

収益分配金額は、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。ただし、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。

収益の分配にあてなかった利益については、信託約款に定める運用の基本方針に基づいて運用を
行います。

(5)【投資制限】

<信託約款に定められた投資制限>

株式

- a. 委託会社は、信託財産に属する株式(株式を組入可能な投資信託証券、新株引受権証券および
新株予約権証券を含みます。以下において同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産
に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産
総額の100分の60以上となる投資の指図をしません。
- b. a.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証
券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じ
て得た額とします。

外貨建資産

- a. 委託会社は、信託財産に属する外貨建資産(外貨建資産を組入可能な投資信託証券を含みま
す。以下において同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時
価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の40以
上となる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上り等により100分の40以上となった場
合には、速やかにこれを調整します。
- b. a.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証
券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合
を乗じて得た額とします。

新株引受権証券および新株予約権証券

- a. 委託会社は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総
額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の中
信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えること
となる投資の指図をしません。
- b. a.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証
券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予
約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

投資信託証券

- a. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。以下同
じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財
産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投
資の指図をしません。

- b . a . において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

同一銘柄の株式等

- a . 委託会社は、取得時において信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- b . a . において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該株式の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- c . 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- d . c . において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

同一銘柄の転換社債等

- a . 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債（新株予約権付社債のうち、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- b . a . において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

スワップ取引

- a . 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- b . スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c . スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとし、
- d . 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとし、

信用取引

- a . 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- b . a . の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとし、
- 1 . 信託財産に属する株券および新株引受権証券により取得する株券
 - 2 . 株式分割により取得する株券
 - 3 . 有償増資により取得する株券
 - 4 . 売出しにより取得する株券
 - 5 . 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（ に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
 - 6 . 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債の新株予約権（ 5 . に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

外国為替予約取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- b. a. の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- c. b. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- d. b. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

有価証券の借入れ

有価証券の借入れを行いません。

資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

投資する株式等の範囲

- a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。
- b. a. の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができます。

金利先渡取引および為替先渡取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- b. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

有価証券の貸付

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. a. に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制限されることがあります。

デリバティブ取引等

デリバティブ取引等(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。)については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。

<その他法令等に定められた投資制限>

- ・同一の法人の発行する株式への投資制限

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。このため、お申込みの際は、当ファンドのリスクを認識・検討し、慎重に投資のご判断を行っていただく必要があります。

価格変動リスク

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動し、また、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動するため、当ファンドはその影響を受け株式や公社債の価格が下落した場合には基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

為替変動リスク

実質的な主要投資対象である海外の株式や公社債は外貨建資産であり、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。そのため、為替相場が円高方向に進んだ場合には、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信用リスク

信用リスクとは、有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等に、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払いや償還金の支払いが滞る等の債務が不履行となること等をいいます。当ファンドは、信用リスクを伴い、その影響を受けますので、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

流動性リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない、または取引が不可能となるリスクのことを流動性リスクといい、当ファンドはそのリスクを伴います。例えば、組み入れている株式や公社債の売却を十分な流動性の下で行えないときは、市場実勢から期待される価格で売却できない可能性があります。この場合、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

留意事項

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリングオフ)の適用はありません。
- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。

(2) 投資リスクに対する管理体制

「投資リスク」をファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うこと、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行うこと、を基本の考え方として、投資リスクの管理体制を構築しています。

また、定期的開催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。

各投資リスクに関する管理体制は以下の通りです。

価格変動リスク・為替変動リスク

価格変動リスク・為替変動リスクは、運用部門において、資産構成比率に関する事項や、その他のファンドのリスク特性に関する事項を主な対象項目として常時把握し、ファンドコンセプトに沿ったリスクの範囲でコントロールしています。

また、価格変動リスク・為替変動リスクは、運用部門から独立した管理担当部署によってリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行う体制をとっており、この結果は運用管理委員会等に報告されます。

信用リスク

信用リスクについては、運用部門においてリスクの把握、ファンド毎に定められたリスクの範囲での運用、を行っているほか、運用部門から独立した管理担当部署でモニタリングを行うなど、価格変動リスク・為替変動リスクと同様の管理体制をとっています。

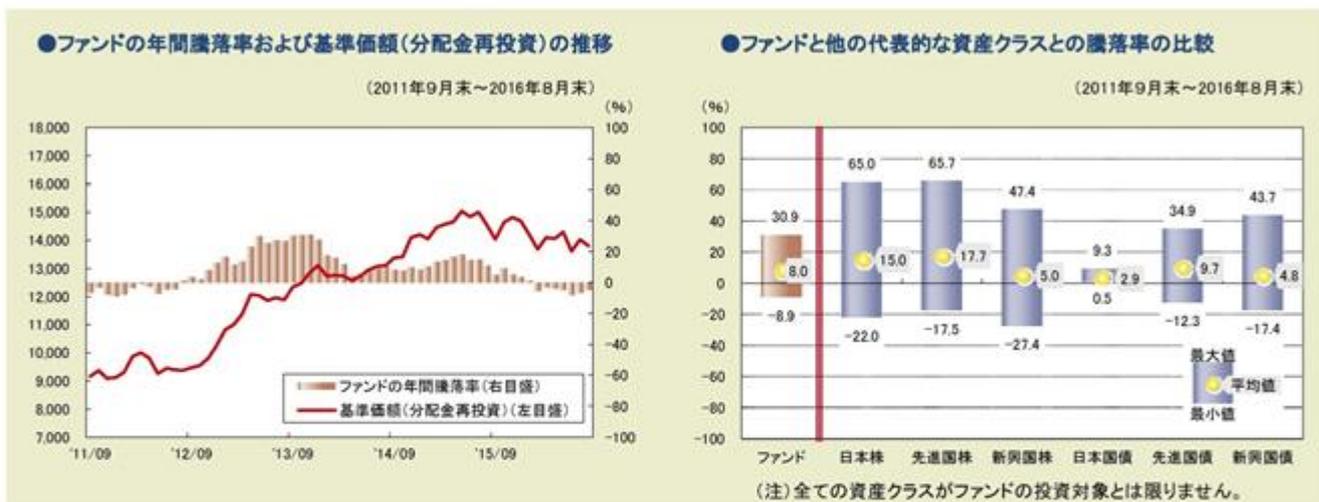
信用リスクは、財務・格付基準に関する事項や、分散投資に関する事項などを主な対象項目として管理していますが、格付等の外形的基準にとどまらず、発行体情報の収集と詳細な分析を行うよう努めています。

流動性リスク

流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立した管理担当部署においても流動性についての情報収集や分析・管理を行い、この結果は運用管理委員会等に報告されます。

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。



- ・基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- ・年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
- ・ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	TOPIX(配当込み)	TOPIX(配当込み)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。TOPIX(配当込み)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、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の停止またはTOPIX(配当込み)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。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	MSCI エマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCI エマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI(国債)	NOMURA-BPI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、NOMURA-BPI(国債)はそのサブインデックスです。わが国の国債で構成されており、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(国債)は野村証券株式会社の知的財産であり、運用成果等に関し、野村証券株式会社は一切関係ありません。
先進国債	シティ世界国債インデックス(除く日本)	シティ世界国債インデックス(除く日本)は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込手数料はかかりません。

(2)【換金（解約）手数料】

解約手数料はかかりません。

換金の詳細については販売会社にご確認ください。

(3)【信託報酬等】

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、以下により計算されます。

信託財産の純資産総額 × 年1.512%（税抜 年1.4%）

1万口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額 × 信託報酬率 ×（保有日数 / 365）

上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

委託会社は、信託報酬から、販売会社に対し、販売会社の行う業務に対する報酬を支払います。したがって、実質的な信託報酬の配分は、次の通りとなります。

委託会社	販売会社	受託会社
年0.7668% (税抜 年0.71%)	年0.6588% (税抜 年0.61%)	年0.0864% (税抜 年0.08%)

信託報酬は、毎計算期間の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。

消費税および地方消費税に相当する金額（「消費税等相当額」といいます。）を含みます。なお、消費税率に応じて変更となることがあります。

(4)【その他の手数料等】

信託財産に係る監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等相当額は、毎計算期間の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。

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

上記の信託事務の処理に要する諸費用には、有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等、外国での資産の保管等に要する費用等が含まれます。

(*)「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。

ご投資家のみなさまにご負担いただく手数料等の合計額については、お申込金額や保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。なお、当ファンドが負担する費用（手数料等）の支払い実績は、交付運用報告書に開示されていますのでご参照ください。

費用または費用を対価とする役務の内容について

費用名	直接・間接	説明
申込手数料	直接	商品および投資環境の説明・情報提供、購入に関する事務手続等の対価
換金（解約）手数料	直接	商品の換金に関する事務手続等の対価
信託財産留保額	直接	信託期間の途中で換金する場合に、換金に必要な費用を賄うため換金代金から控除され、信託財産中に留保される額

信託報酬	間接	（委託会社（再委託先への報酬を含む場合があります。）） ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価 （販売会社） 分配金・償還金・換金代金支払等の事務手続き、交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の説明・情報提供等の対価 （受託会社） 投資信託財産の保管・管理、運用指図の実行等の対価
監査報酬	間接	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
売買委託手数料	間接	有価証券等を売買する際に発生する費用
保管費用 （カストディアン）	間接	外国での資産の保管等に要する費用

上記は一般的な用語について説明したものです。

受益者が直接的に負担する費用か、間接的に負担する費用かの区別です。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金法に定める加入者等の運用の指図に基づいて受益権の取得の申込みを行う資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記以外の場合の課税の取扱いは、次の通りです。

個人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の譲渡益については、次の通り課税されます。

１．収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用があります。）・申告分離課税を選択することもできます。

２．解約時および償還時の課税

解約価額および償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得とみなされて課税されます。

20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

解約時および償還時の損失（譲渡損）については、確定申告により収益分配金を含む上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）との損益通算が可能となる仕組みがあります。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

個別元本について

受益者毎の信託時の受益権の価額等(申込手数料(税込)は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

上記は平成28年8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。

課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成28年8月31日現在
(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	288,359,510	98.87
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		3,289,789	1.13
純資産総額		291,649,299	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28年8月31日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	口数	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	国内債券マザーファンド	親投資信託 受益証券	
日本	国内株式マザーファンド	親投資信託 受益証券		113,117,652	0.7946 0.7891	89,893,889 89,261,139		30.61
日本	世界株式マザーファンド	親投資信託 受益証券		25,493,180	1.7357 1.7691	44,250,401 45,099,984		15.46
日本	世界債券マザーファンド	親投資信託 受益証券		12,797,282	2.3277 2.3592	29,788,412 30,191,347		10.35

(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28年8月31日現在

種類/業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.87
合計	98.87

(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28年8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6計算期間末日 (平成19年 8月14日)	137,609,465 (分配付) 137,609,465 (分配落)	12,998 (分配付) 12,998 (分配落)
第7計算期間末日 (平成20年 8月14日)	129,954,491 (分配付) 129,954,491 (分配落)	11,630 (分配付) 11,630 (分配落)
第8計算期間末日 (平成21年 8月14日)	134,709,029 (分配付) 134,709,029 (分配落)	10,208 (分配付) 10,208 (分配落)
第9計算期間末日 (平成22年 8月16日)	145,501,615 (分配付) 145,501,615 (分配落)	9,627 (分配付) 9,627 (分配落)
第10計算期間末日 (平成23年 8月15日)	153,825,202 (分配付) 153,825,202 (分配落)	9,382 (分配付) 9,382 (分配落)
第11計算期間末日 (平成24年 8月14日)	168,533,594 (分配付) 168,533,594 (分配落)	9,442 (分配付) 9,442 (分配落)
第12計算期間末日 (平成25年 8月14日)	226,940,159 (分配付) 226,940,159 (分配落)	12,129 (分配付) 12,129 (分配落)

第13計算期間末日 （平成26年 8月14日）	269,690,903（分配付） 269,690,903（分配落）	12,991（分配付） 12,991（分配落）
第14計算期間末日 （平成27年 8月14日）	320,138,312（分配付） 320,138,312（分配落）	15,065（分配付） 15,065（分配落）
第15計算期間末日 （平成28年 8月15日）	290,927,508（分配付） 290,927,508（分配落）	13,809（分配付） 13,809（分配落）
平成27年 8月末日	308,914,097	14,520
9月末日	302,799,473	14,032
10月末日	315,385,458	14,632
11月末日	315,183,335	14,811
12月末日	313,488,722	14,678
平成28年 1月末日	303,201,524	14,198
2月末日	290,360,032	13,682
3月末日	294,330,961	14,099
4月末日	295,485,031	14,054
5月末日	300,182,089	14,290
6月末日	287,515,684	13,610
7月末日	296,564,722	14,023
8月末日	291,649,299	13,803

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
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	0円
第14計算期間	0円
第15計算期間	0円

【収益率の推移】

	収益率（％）
第6計算期間	5.96
第7計算期間	10.52
第8計算期間	12.22
第9計算期間	5.69
第10計算期間	2.54
第11計算期間	0.63
第12計算期間	28.45
第13計算期間	7.10
第14計算期間	15.96
第15計算期間	8.33

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第6計算期間	50,389,250	15,335,216	105,868,576
第7計算期間	22,812,870	16,943,300	111,738,146
第8計算期間	30,380,456	10,158,258	131,960,344
第9計算期間	25,789,677	6,616,231	151,133,790
第10計算期間	24,056,196	11,229,991	163,959,995
第11計算期間	22,310,000	7,779,322	178,490,673
第12計算期間	23,378,535	14,756,391	187,112,817
第13計算期間	38,252,620	17,762,426	207,603,011

第14計算期間	52,174,909	47,268,060	212,509,860
第15計算期間	23,663,739	25,489,255	210,684,344

<参考>

「国内債券マザーファンド」

(1) 投資状況

平成28年8月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
国債証券	日本	2,235,349,523	83.15
特殊債券	日本	306,394,000	11.40
社債券	日本	103,179,000	3.84
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		43,258,026	1.61
純資産総額		2,688,180,549	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28年8月31日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	券面総額 (千円)	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	第124回利付国債(5年)	国債証券		341,200	101.02 101.0890	344,710,948 344,915,668	0.100000 2020/06/20	12.83
日本	第120回利付国債(5年)	国債証券		202,000	101.17 101.2110	204,369,460 204,446,220	0.200000 2019/09/20	7.61
日本	第147回利付国債(20年)	国債証券		155,000	123.59 123.5110	191,570,700 191,442,050	1.600000 2033/12/20	7.12
日本	第126回利付国債(5年)	国債証券		156,500	101.14 101.2340	158,285,665 158,431,210	0.100000 2020/12/20	5.89
日本	第153回利付国債(20年)	国債証券		124,000	118.80 118.5320	147,316,960 146,979,680	1.300000 2035/06/20	5.47
日本	第341回利付国債(10年)	国債証券		112,500	103.58 103.7050	116,532,000 116,668,125	0.300000 2025/12/20	4.34
日本	第150回利付国債(20年)	国債証券		94,000	120.44 120.2750	113,221,120 113,058,500	1.400000 2034/09/20	4.21
日本	第61回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債)	特殊債券		100,000	104.56 104.8260	104,567,000 104,826,000	0.690000 2024/06/28	3.90
日本	第7回東日本旅客鉄道	社債券		100,000	103.36 103.1790	103,360,000 103,179,000	3.300000 2017/08/25	3.84
日本	第28回中日本高速道路	特殊債券		100,000	101.22 101.2050	101,228,000 101,205,000	0.782000 2018/03/20	3.76
日本	第73回都市再生債券(財投機関 債)	特殊債券		100,000	100.35 100.3630	100,352,000 100,363,000	0.239000 2018/03/20	3.73
日本	第367回利付国債(2年)	国債証券		97,500	100.60 100.5970	98,089,875 98,082,075	0.100000 2018/08/15	3.65
日本	第140回利付国債(20年)	国債証券		78,500	124.66 124.4860	97,862,270 97,721,510	1.700000 2032/09/20	3.64
日本	第110回利付国債(20年)	国債証券		76,000	126.23 125.9490	95,940,880 95,721,240	2.100000 2029/03/20	3.56
日本	第28回利付国債(30年)	国債証券		60,000	144.79 144.3750	86,874,000 86,625,000	2.500000 2038/03/20	3.22
日本	第119回利付国債(20年)	国債証券		38,000	124.00 123.8940	47,121,140 47,079,720	1.800000 2030/06/20	1.75
日本	第103回利付国債(5年)	国債証券		46,500	100.32 100.3030	46,652,520 46,640,895	0.300000 2017/03/20	1.74
日本	第124回利付国債(20年)	国債証券		36,000	127.35 127.2320	45,846,360 45,803,520	2.000000 2030/12/20	1.70
日本	第127回利付国債(5年)	国債証券		45,000	101.20 101.2830	45,543,150 45,577,350	0.100000 2021/03/20	1.70
日本	第157回利付国債(20年)	国債証券		46,000	98.58 97.5840	45,348,890 44,888,640	0.200000 2036/06/20	1.67
日本	第335回利付国債(10年)	国債証券		42,000	105.12 105.2100	44,151,240 44,188,200	0.500000 2024/09/20	1.64
日本	第35回利付国債(30年)	国債証券		30,000	138.88 138.4780	41,666,700 41,543,400	2.000000 2041/09/20	1.55
日本	第294回利付国債(10年)	国債証券		38,500	103.48 103.4450	39,839,800 39,826,325	1.700000 2018/06/20	1.48
日本	第122回利付国債(5年)	国債証券		33,000	100.91 100.9620	33,300,960 33,317,460	0.100000 2019/12/20	1.24

日本	第46回利付国債(30年)	国債証券	24,000	129.73 129.6760	31,136,640 31,122,240	1.500000 2045/03/20	1.16
日本	第88回利付国債(20年)	国債証券	23,500	123.22 123.2580	28,957,875 28,965,630	2.300000 2026/06/20	1.08
日本	第128回利付国債(5年)	国債証券	27,500	101.27 101.3540	27,850,075 27,872,350	0.100000 2021/06/20	1.04
日本	第129回利付国債(20年)	国債証券	20,000	124.98 124.8790	24,996,800 24,975,800	1.800000 2031/06/20	0.93
日本	第41回利付国債(30年)	国債証券	16,000	133.87 133.6390	21,420,320 21,382,240	1.700000 2043/12/20	0.80
日本	第8回利付国債(40年)	国債証券	15,000	131.89 132.5110	19,784,850 19,876,650	1.400000 2055/03/20	0.74

(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28年8月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	83.15
特殊債券	11.40
社債券	3.84
合計	98.39

(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。

< 参考 >

「国内株式マザーファンド」

(1) 投資状況

平成28年8月31日現在

(単位: 円)

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率 (%)
株式	日本	1,794,444,050	98.64
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		24,657,695	1.36
純資産総額		1,819,101,745	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28年8月31日現在

国 / 地域	銘柄	種類	業種	株式数	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	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	105,000	531.40 564.10	55,797,000 59,230,500		3.26
日本	日本電信電話	株式	情報・通信業	11,100	4,771.00 4,546.00	52,958,100 50,460,600		2.77
日本	三菱商事	株式	卸売業	23,400	2,002.50 2,155.50	46,858,500 50,438,700		2.77
日本	KDDI	株式	情報・通信業	16,400	3,246.00 3,036.00	53,234,400 49,790,400		2.74
日本	日産自動車	株式	輸送用機器	38,500	994.00 1,015.00	38,269,000 39,077,500		2.15
日本	東京海上ホールディングス	株式	保険業	9,200	3,886.07 4,064.00	35,751,899 37,388,800		2.06
日本	三和ホールディングス	株式	金属製品	39,900	972.00 918.00	38,782,800 36,628,200		2.01
日本	塩野義製薬	株式	医薬品	7,400	5,159.00 4,619.00	38,176,600 34,180,600		1.88
日本	大成建設	株式	建設業	39,000	785.00 778.00	30,615,000 30,342,000		1.67
日本	ソニー	株式	電気機器	9,100	3,297.00 3,325.00	30,002,700 30,257,500		1.66
日本	花王	株式	化学	5,400	5,185.00 5,377.00	27,999,000 29,035,800		1.60

日本	三井住友フィナンシャルグループ	株式	銀行業	8,000	3,378.00 3,621.00	27,024,000 28,968,000		1.59
日本	東ソー	株式	化学	45,000	585.65 637.00	26,354,583 28,665,000		1.58
日本	富士フイルムホールディングス	株式	化学	7,200	3,792.00 3,887.00	27,302,400 27,986,400		1.54
日本	オリエンタルランド	株式	サービス業	4,400	6,175.00 6,059.00	27,170,000 26,659,600		1.47
日本	楽天	株式	サービス業	20,300	1,214.72 1,304.00	24,658,897 26,471,200		1.46
日本	村田製作所	株式	電気機器	1,900	12,590.00 13,905.00	23,921,000 26,419,500		1.45
日本	朝日インテック	株式	精密機器	5,700	4,455.00 4,600.00	25,393,500 26,220,000		1.44
日本	積水ハウス	株式	建設業	15,600	1,661.00 1,666.00	25,911,600 25,989,600		1.43
日本	いすゞ自動車	株式	輸送用機器	21,400	1,243.50 1,190.50	26,610,900 25,476,700		1.40
日本	マブチモーター	株式	電気機器	4,600	5,070.00 5,490.00	23,322,000 25,254,000		1.39
日本	カカクコム	株式	サービス業	14,200	1,806.00 1,730.00	25,645,200 24,566,000		1.35
日本	オリックス	株式	その他金融業	16,400	1,426.00 1,487.50	23,386,400 24,395,000		1.34
日本	パーク24	株式	不動産業	8,000	3,095.00 3,025.00	24,760,000 24,200,000		1.33
日本	シスメックス	株式	電気機器	3,600	6,690.00 6,670.00	24,084,000 24,012,000		1.32
日本	フジシールインターナショナル	株式	その他製品	6,100	3,805.00 3,930.00	23,210,500 23,973,000		1.32
日本	ニフコ	株式	化学	4,600	5,360.00 5,210.00	24,656,000 23,966,000		1.32
日本	小糸製作所	株式	電気機器	4,800	5,040.00 4,925.00	24,192,000 23,640,000		1.30
日本	セブン&アイ・ホールディングス	株式	小売業	5,400	4,364.00 4,361.00	23,565,600 23,549,400		1.29
日本	日本新薬	株式	医薬品	4,900	4,970.00 4,795.00	24,353,000 23,495,500		1.29

(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28年8月31日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	鉱業	0.37
	建設業	5.24
	食料品	3.74
	繊維製品	1.04
	化学	6.60
	医薬品	4.25
	ゴム製品	0.70
	ガラス・土石製品	3.15
	鉄鋼	0.82
	非鉄金属	0.52
	金属製品	2.01
	機械	6.85
	電気機器	11.07
	輸送用機器	6.29
	精密機器	1.44
	その他製品	1.32
	陸運業	2.38
	空運業	0.86
	情報・通信業	8.71
	卸売業	4.00
	小売業	5.46
	銀行業	6.93
	証券、商品先物取引業	0.47
	保険業	3.12
	その他金融業	1.34
	不動産業	4.55
	サービス業	5.39
	合計	98.64

(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。

< 参考 >

「世界債券マザーファンド」

(1) 投資状況

平成28年8月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	250,809,125	42.52
	フランス	76,676,518	13.00
	ベルギー	48,229,292	8.18
	イギリス	41,113,344	6.97
	アイルランド	40,312,769	6.83
	ドイツ	38,691,653	6.56
	フィンランド	12,261,230	2.08
	カナダ	11,496,136	1.95
	オーストラリア	11,143,937	1.89
	オーストリア	10,345,316	1.75
	オランダ	5,730,542	0.97
	メキシコ	5,002,173	0.85
	デンマーク	3,831,999	0.65
	ポーランド	3,258,343	0.55
	スウェーデン	2,654,549	0.45
	シンガポール	2,318,369	0.39
	マレーシア	2,209,700	0.37
スイス	2,080,751	0.35	
ノルウェー	1,707,664	0.29	
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		20,031,196	3.40
純資産総額		589,904,606	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28年8月31日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	券面総額	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)		
アメリカ	0.875 T-NOTE 171130	国債証券		381,000.00	10,344.19 10,339.3614	39,411,394 39,392,966	0.875000 2017/11/30	6.68
アメリカ	3.625 T-NOTE 210215	国債証券		340,000.00	11,467.48 11,417.5118	38,989,464 38,819,540	3.625000 2021/02/15	6.58
アメリカ	1.75 T-NOTE 230131	国債証券		336,000.00	10,571.11 10,545.3184	35,518,941 35,432,269	1.750000 2023/01/31	6.01
アメリカ	2.125 T-NOTE 250515	国債証券		270,000.00	10,816.97 10,806.4928	29,205,823 29,177,529	2.125000 2025/05/15	4.95
アイルラ ンド	4.5 IRISH GOVT 181018	国債証券		220,000.00	12,742.20 12,697.9517	28,032,856 27,935,493	4.500000 2018/10/18	4.74
アメリカ	3.75 T-NOTE 181115	国債証券		249,000.00	11,010.83 10,974.9664	27,416,984 27,327,665	3.750000 2018/11/15	4.63
フランス	0.5 O.A.T 250525	国債証券		211,000.00	11,984.80 11,991.8139	25,287,932 25,302,727	0.500000 2025/05/25	4.29
アメリカ	4.375 T-BOND 380215	国債証券		156,000.00	14,619.31 14,639.4685	22,806,133 22,837,570	4.375000 2038/02/15	3.87
ベルギー	0.8 BEL GOVT 250622	国債証券		165,000.00	12,275.62 12,300.2247	20,254,781 20,295,370	0.800000 2025/06/22	3.44
アメリカ	2.75 T-BOND 420815	国債証券		147,000.00	11,339.32 11,461.8470	16,668,801 16,848,914	2.750000 2042/08/15	2.86
フランス	4 O.A.T 550425	国債証券		70,000.00	21,941.08 21,841.9943	15,358,756 15,289,396	4.000000 2055/04/25	2.59
フランス	5.5 O.A.T 290425	国債証券		73,000.00	18,965.02 18,916.5168	13,844,468 13,809,057	5.500000 2029/04/25	2.34

イギリス	4.25 GILT 360307	国債証券	63,000.00	20,295.03 20,897.3590	12,785,869 13,165,336	4.250000 2036/03/07	2.23
アメリカ	1.875 T-NOTE 200630	国債証券	122,000.00	10,658.57 10,626.7339	13,003,460 12,964,614	1.875000 2020/06/30	2.20
フランス	3.75 O.A.T 210425	国債証券	93,000.00	13,782.27 13,761.3542	12,817,515 12,798,059	3.750000 2021/04/25	2.17
ドイツ	4.25 BUND 390704	国債証券	58,000.00	21,505.76 21,518.7549	12,473,344 12,480,877	4.250000 2039/07/04	2.12
ベルギー	4.25 BEL GOVT 410328	国債証券	61,000.00	20,356.49 20,348.2191	12,417,462 12,412,413	4.250000 2041/03/28	2.10
ベルギー	4.25 BEL GOVT 220928	国債証券	84,000.00	14,805.10 14,775.9029	12,436,284 12,411,758	4.250000 2022/09/28	2.10
フィンランド	0.375 FINNISH GOV 200915	国債証券	103,000.00	11,908.13 11,904.1070	12,265,374 12,261,230	0.375000 2020/09/15	2.08
カナダ	2.5 CAN GOVT 240601	国債証券	130,000.00	8,836.65 8,843.1822	11,487,646 11,496,136	2.500000 2024/06/01	1.95
ドイツ	1.5 BUND 240515	国債証券	83,000.00	13,182.00 13,191.3171	10,941,065 10,948,793	1.500000 2024/05/15	1.86
オーストラリア	3.25 AUST GOVT 250421	国債証券	125,000.00	8,627.01 8,643.5276	10,783,772 10,804,409	3.250000 2025/04/21	1.83
オーストリア	4.35 AUSTRIA GOVT 190315	国債証券	80,000.00	12,968.08 12,931.6451	10,374,467 10,345,316	4.350000 2019/03/15	1.75
アメリカ	1.25 T-NOTE 191031	国債証券	97,000.00	10,433.27 10,414.7312	10,120,273 10,102,288	1.250000 2019/10/31	1.71
イギリス	4.25 GILT 551207	国債証券	36,000.00	25,432.02 26,994.1645	9,155,528 9,717,899	4.250000 2055/12/07	1.65
アメリカ	2.375 T-NOTE 240815	国債証券	76,000.00	11,024.13 10,996.7309	8,378,344 8,357,514	2.375000 2024/08/15	1.42
ドイツ	2.25 BUND 210904	国債証券	61,000.00	13,152.00 13,134.4169	8,022,722 8,011,994	2.250000 2021/09/04	1.36
ドイツ	4.75 BUND 280704	国債証券	40,000.00	18,147.15 18,124.9711	7,258,862 7,249,988	4.750000 2028/07/04	1.23
アイルランド	2 IRISH GOVT 450218	国債証券	49,000.00	13,781.92 13,790.5515	6,753,145 6,757,370	2.000000 2045/02/18	1.15
フランス	1 O.A.T 181125	国債証券	50,000.00	11,906.17 11,900.0838	5,953,088 5,950,041	1.000000 2018/11/25	1.01

（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28年8月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	96.60
合計	96.60

（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。

< 参考 >

「世界株式マザーファンド」

(1) 投資状況

平成28年8月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率 (%)
株式	アメリカ	702,458,670	70.45
	イギリス	68,839,928	6.90
	スウェーデン	64,091,921	6.43
	オーストラリア	36,731,000	3.68
	スイス	19,147,411	1.92
	香港	17,593,891	1.76
	フランス	17,128,351	1.72
	ドイツ	16,170,472	1.62
	デンマーク	13,266,921	1.33
	ベルギー	12,394,956	1.24
	フィンランド	5,915,631	0.59
	イタリア	5,304,063	0.53
	スペイン	5,181,003	0.52
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		12,848,616	1.31
純資産総額		997,072,834	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28年8月31日現在

国 / 地域	銘柄	種類	業種	株式数	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)		
アメリカ	AMAZON.COM INC	株式	小売	560	79,033.81 79,198.90	44,258,937 44,351,386		4.45
アメリカ	FIRST REPUBLIC BANK/CA	株式	銀行	4,110	7,587.85 7,902.55	31,186,093 32,479,505		3.26
アメリカ	ILLUMINA INC	株式	医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエンス	1,298	17,182.56 17,436.38	22,302,969 22,632,431		2.27
アメリカ	FACEBOOK INC-A	株式	ソフトウェア・ サービス	1,717	12,912.97 12,984.17	22,171,581 22,293,821		2.24
アメリカ	MARKETAXESS HOLDINGS INC	株式	各種金融	1,243	16,800.79 17,431.22	20,883,393 21,667,017		2.17
アメリカ	MARTIN MARIETTA MATERIALS	株式	素材	1,026	20,461.62 19,483.47	20,993,628 19,990,049		2.00
アメリカ	MARKEL CORP	株式	保険	198	96,124.55 95,792.31	19,032,661 18,966,877		1.90
アメリカ	ALPHABET INC-CL C	株式	ソフトウェア・ サービス	235	80,709.45 79,354.70	18,966,723 18,648,355		1.87
アメリカ	WATERS CORP	株式	医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエンス	1,094	16,225.05 16,252.91	17,750,210 17,780,687		1.78
アメリカ	TESLA MOTORS INC	株式	自動車・ 自動車部品	772	23,734.49 21,806.06	18,323,030 16,834,279		1.69
アメリカ	TD AMERITRADE HOLDING CORP	株式	各種金融	4,911	3,235.72 3,392.55	15,890,644 16,660,854		1.67
アメリカ	GRUBHUB INC	株式	ソフトウェア・ サービス	4,024	3,999.25 4,110.69	16,093,009 16,541,421		1.66
アメリカ	M & T BANK CORP	株式	銀行	1,270	12,092.69 12,170.08	15,357,723 15,456,002		1.55
アメリカ	WATSCO INC	株式	資本財	986	14,737.19 15,341.83	14,530,878 15,127,048		1.52
アメリカ	ABIOMED INC	株式	ヘルスケア機器・ サービス	1,205	12,407.39 12,313.50	14,950,910 14,837,768		1.49
アメリカ	HARLEY-DAVIDSON INC	株式	自動車・ 自動車部品	2,576	5,519.09 5,442.74	14,217,196 14,020,511		1.41
アメリカ	MASTERCARD INC-CLASS A	株式	ソフトウェア・ サービス	1,358	9,996.07 10,017.74	13,574,674 13,604,099		1.36
アメリカ	TRIPADVISOR INC	株式	小売	2,126	6,274.37 6,319.77	13,339,322 13,435,841		1.35

アメリカ	CARMAX INC	株式	小売	2,155	6,072.14 6,139.21	13,085,468 13,229,997		1.33
アメリカ	GOLDMAN SACHS GROUP INC	株式	各種金融	737	16,724.44 17,475.59	12,325,916 12,879,514		1.29
アメリカ	ALPHABET INC-CL A	株式	ソフトウェア・サービス	156	83,259.03 81,710.30	12,988,409 12,746,807		1.28
スウェーデン	ATLAS COPCO AB-A SHS	株式	資本財	4,266	2,889.53 2,959.60	12,326,760 12,625,653		1.27
アメリカ	TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	株式	ソフトウェア・サービス	2,008	5,541.79 6,078.33	11,127,929 12,205,294		1.22
スウェーデン	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	株式	銀行	9,176	1,262.36 1,325.17	11,583,415 12,159,814		1.22
アメリカ	VERISK ANALYTICS INC	株式	商業・専門サービス	1,415	8,478.30 8,563.94	11,996,795 12,117,975		1.22
アメリカ	AMERICAN EXPRESS CO	株式	各種金融	1,752	6,760.35 6,753.13	11,844,139 11,831,485		1.19
スウェーデン	INVESTOR AB-B SHS	株式	各種金融	3,056	3,512.86 3,644.53	10,735,312 11,137,702		1.12
アメリカ	COLGATE-PALMOLIVE CO	株式	家庭用品・パーソナル用品	1,448	7,695.16 7,686.91	11,142,598 11,130,645		1.12
アメリカ	ELLIE MAE INC	株式	ソフトウェア・サービス	1,091	10,062.11 10,115.76	10,977,765 11,036,302		1.11
アメリカ	EOG RESOURCES INC	株式	エネルギー	1,168	9,302.70 9,293.42	10,865,563 10,854,717		1.09

(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28年8月31日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	2.60
	素材	5.02
	資本財	12.04
	商業・専門サービス	3.13
	運輸	1.72
	自動車・自動車部品	3.40
	耐久消費財・アパレル	1.60
	消費者サービス	2.07
	小売	11.59
	食品・生活必需品小売り	1.28
	食品・飲料・タバコ	3.02
	家庭用品・パーソナル用品	2.77
	ヘルスケア機器・サービス	3.40
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.18
	銀行	7.31
	各種金融	12.39
	保険	2.91
	ソフトウェア・サービス	11.66
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.00
	半導体・半導体製造装置	1.60
合計	98.71	

(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。

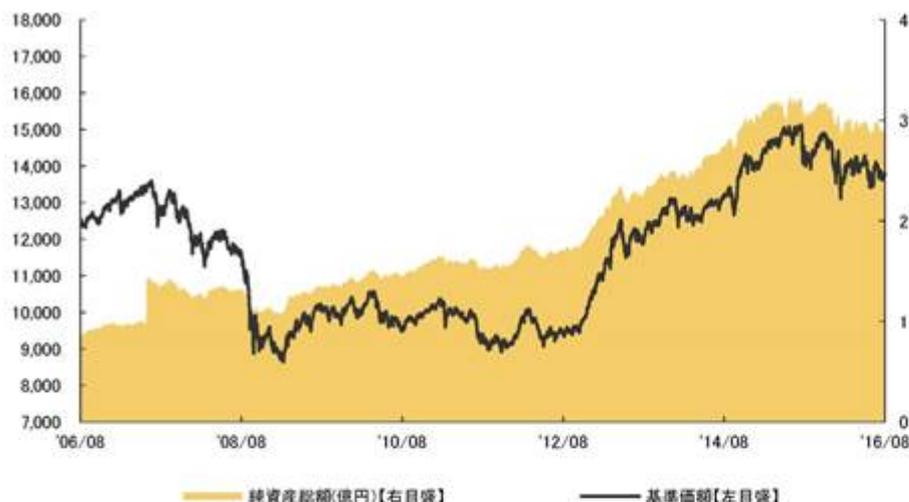
[参考情報]



運用実績

2016年8月31日現在

■基準価額・純資産の推移 2006年8月31日～2016年8月31日



・基準価額は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	13,803円
純資産総額	2.9億円

■分配の推移

2016年 8月	0円
2015年 8月	0円
2014年 8月	0円
2013年 8月	0円
2012年 8月	0円
2011年 8月	0円
設定来累計	0円

・分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

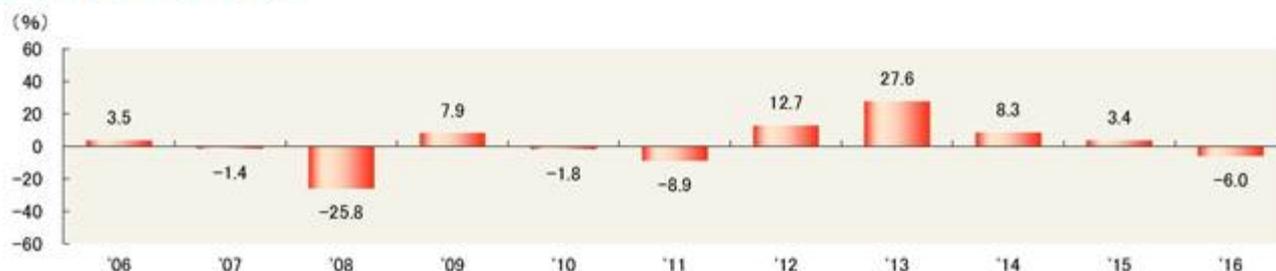
資産別構成	比率
国内株式	30.2%
国内債券	41.8%
外国株式	15.3%
外国債券	10.0%
コールローン他 (負債控除後)	2.7%
合計	100.0%

通貨別構成	比率
円	74.6%
アメリカドル	15.3%
ユーロ	5.1%
イギリスポンド	1.8%
スウェーデンクローネ	1.0%
オーストラリアドル	0.8%
スイスフラン	0.3%
デンマーククローネ	0.3%
その他	0.8%
合計	100.0%

組入上位銘柄	種類	業種/種別	国・地域	比率
三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	日本	1.0%
日本電信電話	株式	情報・通信業	日本	0.8%
三菱商事	株式	卸売業	日本	0.8%
KDDI	株式	情報・通信業	日本	0.8%
AMAZON.COM INC	株式	小売	アメリカ	0.7%
第124回利付国債(5年)	債券	国債	日本	5.4%
第120回利付国債(5年)	債券	国債	日本	3.2%
第147回利付国債(20年)	債券	国債	日本	3.0%
第126回利付国債(5年)	債券	国債	日本	2.5%
第153回利付国債(20年)	債券	国債	日本	2.3%

- ・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)
- ・投資信託証券(リートを含む)の組入れがある場合、株式に含めて表示
- ・コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。
- ・国内株式の業種は、東京証券取引所の33業種分類によるもの
- ・外国株式の業種は、GICS(世界産業分類基準)によるもの。Global Industry Classification Standard ("GICS")は、MSCI Inc.とS&P(Standard & Poor's)が開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。

■年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額で計算
- ・2016年は年初から8月31日までの収益率を表示

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。
運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込みの受付	原則として、いつでも申込みができます。
申込単位	1円以上1円単位
申込価額	申込受付日の翌営業日の基準価額
申込価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
申込価額の照会方法	申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。 また、下記においてもご照会いただけます。 三菱UFJ国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/
申込手数料	ありません。
申込方法	取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。 取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。 なお、取得申込者と販売会社との間で別に定める累積投資契約（販売会社によっては別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を使用する場合があります、この場合は当該別の名称に読み替えます。）を締結するものとします。 取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。
申込受付時間	原則、午後3時までに受け付けた取得申込み（当該申込みの受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを）を当日の申込みとします。当該時刻を過ぎての申込みは、翌営業日に受け付けたものとして取り扱います。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に取得申込みを締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。
その他	金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みを取り消すことがあります。

2【換金（解約）手続等】

解約の受付	原則として、いつでも解約の請求ができます。
解約単位	1口単位
解約価額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額
信託財産留保額	ありません。
解約価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
解約価額の照会方法	解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。 なお、下記においてもご照会いただけます。 三菱UFJ国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/
支払開始日	原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。
解約請求受付時間	原則、午後3時までに受け付けた解約請求（当該解約請求の受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを）を当日の請求とします。当該時刻を過ぎての請求は、翌営業日に受け付けたものとして取り扱います。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に解約請求を締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

その他	<p>委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求を取り消すことがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとします。</p> <p>委託会社は、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。</p> <p>受益者の解約請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。</p>
-----	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

換金の詳細については販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出方法	<p>基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数</p> <p>なお、当ファンドでは1万口当たりの価額で表示されます。</p> <p>(注)「信託財産の純資産総額」とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券を除きます。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。</p> <p>(主な評価方法)</p> <p>マザーファンド：計算日における基準価額で評価します。</p> <p>株式：原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場(外国で取引されているものについては、原則として、外国金融商品市場における計算時に知りうる直近の日の最終相場)で評価します。</p> <p>公社債等：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)、第一種金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額で評価します。</p> <p>外貨建資産：原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円換算します。</p> <p>外国為替予約取引：原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。</p>
基準価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
基準価額の照会方法	<p>基準価額は、販売会社にてご確認ください。</p> <p>また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。</p> <p>なお、下記においてもご照会いただけます。</p> <p>三菱UFJ国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/</p>

(2)【保管】

受益証券の保管	該当事項はありません。
---------	-------------

(3)【信託期間】

信託期間	<p>平成13年10月18日から無期限</p> <p>ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。</p>
------	---------------------------------------------------------------------------

(4) 【計算期間】

計算期間	原則として、毎年8月15日から翌年8月14日まで 上記にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日が休業日のとき、各計算期間終了日は、この該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日はファンドの信託期間終了日とします。
------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(5) 【その他】

ファンドの償還条件等	委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。（任意償還） ・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合 ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。 委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。
信託約款の変更	委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。委託会社は、信託約款を変更しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。
ファンドの償還等に関する開示方法	委託会社は、ファンドの任意償還または信託約款の変更のうち重大な内容の変更を行おうとする場合、あらかじめその旨およびその内容を公告し、かつ、原則としてこれらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。この公告および書面には、原則として、受益者で異議のあるものは一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。
異議申立ておよび反対者の買取請求権	受益者は、委託会社がファンドの任意償還または信託約款について重大な内容の変更を行おうとする場合、原則として、一定の期間（1ヵ月以上）内に委託会社に対して異議を述べるすることができます。異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。なお、一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、ファンドの償還または信託約款の変更を行いません。その場合、償還しない旨または信託約款を変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、原則として、これらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。
関係法人との契約の更改	委託会社と販売会社との間で締結された「募集・販売の取扱い等に関する契約」の期間は、契約締結日から1ヵ年とし、期間満了3ヵ月前までに相手方に対し、何らの意思表示のないときは、同一の条件で契約を更新するものとし、その後も同様とします。
運用報告書	委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、交付運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更等があった場合は、その内容を交付運用報告書に記載します。
委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い	委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

受託会社の辞任および解任に伴う取扱い	受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。
信託事務処理の再信託	受託会社は、ファンドの信託事務の処理の一部について日本マスタートラスト信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託します。日本マスタートラスト信託銀行株式会社は、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。
公告	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。

4【受益者の権利等】

受益者の権利の主な内容は以下の通りです。

収益分配金に対する請求権	受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分にに応じて請求する権利を有します。 ・収益分配金は、原則として毎計算期間の終了日(決算日)の翌営業日に、累積投資契約に基づいて再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。詳しくは販売会社にご確認ください。
償還金に対する請求権	受益者は、持分にに応じて償還金を請求する権利を有します。 ・償還金は、原則として償還日(休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までに支払いを開始します。 ・償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。 ・受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。
換金(解約)請求権	受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約を請求する権利を有します。 ・解約代金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。 (「2 換金(解約)手続等」をご参照ください。)

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「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)ならびに同規則第2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、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期(平成27年8月15日から平成28年8月15日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（安定成長型）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第 14 期 [平成27年8月14日現在]	第 15 期 [平成28年8月15日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,867,976	6,284,969
親投資信託受益証券	316,625,659	287,677,571
未収利息	9	-
流動資産合計	322,493,644	293,962,540
資産合計	322,493,644	293,962,540
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	809,834
未払受託者報酬	134,252	126,828
未払委託者報酬	2,215,102	2,092,727
未払利息	-	7
その他未払費用	5,978	5,636
流動負債合計	2,355,332	3,035,032
負債合計	2,355,332	3,035,032
純資産の部		
元本等		
元本	1,212,509,860	1,210,684,344
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	107,628,452	80,243,164
（分配準備積立金）	69,007,947	61,203,189
元本等合計	320,138,312	290,927,508
純資産合計	320,138,312	290,927,508
負債純資産合計	322,493,644	293,962,540

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 14 期 自 平成26年 8月15日 至 平成27年 8月14日	第 15 期 自 平成27年 8月15日 至 平成28年 8月15日
営業収益		
受取利息	2,801	1,483
有価証券売買等損益	48,539,933	21,948,088
営業収益合計	48,542,734	21,946,605
営業費用		
支払利息	-	863
受託者報酬	259,646	260,603
委託者報酬	4,284,096	4,299,868
その他費用	11,562	11,596
営業費用合計	4,555,304	4,572,930
営業利益又は営業損失()	43,987,430	26,519,535
経常利益又は経常損失()	43,987,430	26,519,535
当期純利益又は当期純損失()	43,987,430	26,519,535
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	6,842,970	2,018,379
期首剰余金又は期首欠損金()	62,087,892	107,628,452
剰余金増加額又は欠損金減少額	23,122,605	9,916,784
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	23,122,605	9,916,784
剰余金減少額又は欠損金増加額	14,726,505	12,800,916
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	14,726,505	12,800,916
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金()	107,628,452	80,243,164

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年8月14日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成27年8月15日から平成28年8月15日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第 14 期 [平成27年8月14日現在]	第 15 期 [平成28年8月15日現在]
1 期首元本額	207,603,011円	212,509,860円
期中追加設定元本額	52,174,909円	23,663,739円
期中一部解約元本額	47,268,060円	25,489,255円
2 受益権の総数	212,509,860口	210,684,344口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5065円 (15,065円)	1.3809円 (13,809円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 14 期 (自 平成26年8月15日 至 平成27年8月14日)

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	3,933,550円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	33,210,910円
収益調整金額	C	59,826,136円
分配準備積立金額	D	31,863,487円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	128,834,083円
当ファンドの期末残存口数	F	212,509,860口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	6,062円
1万口当たり分配金額	H	
収益分配金金額	I=F*H/10,000	

第 15 期 (自 平成27年8月15日 至 平成28年8月15日)

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	
収益調整金額	C	66,564,962円
分配準備積立金額	D	61,203,189円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	127,768,151円
当ファンドの期末残存口数	F	210,684,344口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	6,064円
1万口当たり分配金額	H	
収益分配金金額	I=F*H/10,000	

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区 分	第 14 期 (自 平成26年 8月15日 至 平成27年 8月14日)	第 15 期 (自 平成27年 8月15日 至 平成28年 8月15日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 親投資信託受益証券は、外貨の決済のために為替予約取引を利用してしております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。	同 左 同 左

3 金融商品に係るリスク管理体制	また、親投資信託受益証券に係るデリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、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。	同 左
	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 14 期 [平成27年8月14日現在]	第 15 期 [平成28年8月15日現在]
	1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 時価の算定方法	<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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 14 期 [平成27年8月14日現在]	第 15 期 [平成28年8月15日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	38,450,895	17,802,471
合計	38,450,895	17,802,471

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	口数	評 価 額	備 考
親投資信託受益証券	国内債券マザーファンド	86,357,755	123,301,602	
	国内株式マザーファンド	111,832,098	88,906,517	
	世界債券マザーファンド	12,712,218	29,592,772	
	世界株式マザーファンド	26,429,704	45,876,680	
	親投資信託受益証券 小計	237,331,775	287,677,571	
	合計	237,331,775	287,677,571	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

<参考>

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

「国内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。

(1) 貸借対照表

	[平成27年8月14日現在]	[平成28年8月15日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	28,193,495	167,804,475
国債証券	2,350,685,080	2,246,995,851
特殊債券	202,074,000	306,304,000
社債券	106,480,000	103,292,000
未収利息	7,773,853	6,544,839
前払費用	281,710	113,692
流動資産合計	2,695,488,138	2,831,054,857
資産合計	2,695,488,138	2,831,054,857
負債の部		
流動負債		
未払金		149,749,975
未払利息		207
流動負債合計		149,750,182
負債合計		149,750,182
純資産の部		
元本等		
元本	1	2,014,823,370
1	2,014,823,370	1,877,928,294
剰余金		
剰余金又は欠損金()	680,664,768	803,376,381
元本等合計	2,695,488,138	2,681,304,675
純資産合計	2,695,488,138	2,681,304,675
負債純資産合計	2,695,488,138	2,831,054,857

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年2月8日から8月7日まで、および8月8日から翌年2月7日までであります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
-------------------	-------------------------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

	[平成27年8月14日現在]	[平成28年8月15日現在]
1 期首		
期首元本額	平成26年8月15日 1,908,319,683円	平成27年8月15日 2,014,823,370円
期首からの追加設定元本額	531,595,338円	554,845,030円
期首からの一部解約元本額	425,091,651円	691,740,106円
元本の内訳*		
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定型)	424,716,952円	395,381,257円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定成長型)	241,302,205円	220,346,758円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(成長型)	162,834,231円	145,721,320円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(積極型)	160,129,952円	143,251,418円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2020	152,498,966円	129,472,136円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2030	228,118,884円	218,668,562円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2040	161,856,734円	154,086,388円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定型)	73,709,363円	71,983,421円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定成長型)	93,391,213円	86,357,755円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(成長型)	40,306,334円	38,864,238円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(積極型)	35,699,059円	33,152,694円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤーファンド 2020	83,079,732円	74,189,557円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤーファンド 2030	91,859,327円	96,846,876円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤーファンド 2040	65,320,418円	69,605,914円
(合計)	2,014,823,370円	1,877,928,294円
2 受益権の総数	2,014,823,370口	1,877,928,294口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3378円 (13,378円)	1.4278円 (14,278円)

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区 分	（自平成26年8月15日 至平成27年8月14日）	（自平成27年8月15日 至平成28年8月15日）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成27年8月14日現在]	[平成28年8月15日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。	同 左
2 時価の算定方法	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。 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 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。	同 左 同 左 同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	[平成27年8月14日現在]	[平成28年8月15日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	5,484,565	10,190,028
特殊債券	14,000	157,000
社債券	61,000	68,000
合計	5,409,565	10,279,028

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評 価 額	備 考
国債証券	第367回利付国債（2年）	97,500,000	98,065,500	
	第103回利付国債（5年）	46,500,000	46,649,265	
	第106回利付国債（5年）	7,500,000	7,533,225	
	第120回利付国債（5年）	202,000,000	204,417,940	
	第122回利付国債（5年）	33,000,000	33,316,140	
	第124回利付国債（5年）	341,200,000	344,826,956	
	第126回利付国債（5年）	156,500,000	158,313,835	
	第127回利付国債（5年）	45,000,000	45,551,250	
	第128回利付国債（5年）	27,500,000	27,855,575	
	第8回利付国債（40年）	15,000,000	20,354,550	
	第294回利付国債（10年）	38,500,000	39,836,720	
	第335回利付国債（10年）	42,000,000	44,254,560	
	第341回利付国債（10年）	112,500,000	116,853,750	
	第28回利付国債（30年）	60,000,000	87,832,200	
	第31回利付国債（30年）	10,000,000	14,241,800	
	第35回利付国債（30年）	30,000,000	42,196,800	

	第41回利付国債(30年)	16,000,000	21,715,200	
	第46回利付国債(30年)	24,000,000	31,624,800	
	第50回利付国債(30年)	15,000,000	16,969,050	
	第88回利付国債(20年)	23,500,000	29,047,645	
	第110回利付国債(20年)	76,000,000	96,273,760	
	第119回利付国債(20年)	38,000,000	47,368,900	
	第124回利付国債(20年)	36,000,000	46,095,120	
	第129回利付国債(20年)	20,000,000	25,156,000	
	第140回利付国債(20年)	78,500,000	98,470,400	
	第147回利付国債(20年)	155,000,000	193,314,450	
	第150回利付国債(20年)	94,000,000	114,395,180	
	第153回利付国債(20年)	124,000,000	148,900,440	
	第157回利付国債(20年)	46,000,000	45,564,840	
	国債証券 小計	2,010,700,000	2,246,995,851	
特殊債券	第61回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	104,724,000	
	第73回都市再生債券(財投機関債)	100,000,000	100,357,000	
	第28回中日本高速道路	100,000,000	101,223,000	
	特殊債券 小計	300,000,000	306,304,000	
社債券	第7回東日本旅客鉄道	100,000,000	103,292,000	
	社債券 小計	100,000,000	103,292,000	
	合計	2,410,700,000	2,656,591,851	

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

「国内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。

(1) 貸借対照表

	[平成27年8月14日現在]	[平成28年8月15日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	34,060,996	10,606,932
株式	2,066,761,880	1,807,374,770
未収入金	25,013,465	
未収配当金	1,384,705	2,159,100
未収利息	55	
流動資産合計	2,127,221,101	1,820,140,802
資産合計	2,127,221,101	1,820,140,802
負債の部		
流動負債		
未払金	23,869,897	
未払利息		13
流動負債合計	23,869,897	13
負債合計	23,869,897	13
純資産の部		
元本等		
元本	1	2,170,898,953
剰余金		2,289,449,543
剰余金又は欠損金()	2	67,547,749
元本等合計		2,103,351,204
純資産合計		2,103,351,204
負債純資産合計		2,127,221,101

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年2月8日から8月7日まで、および8月8日から翌年2月7日までであります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
-------------------	---------------------------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

	[平成27年8月14日現在]	[平成28年8月15日現在]
1 期首		
期首元本額	平成26年8月15日 2,795,538,798円	平成27年8月15日 2,170,898,953円
期首からの追加設定元本額	298,078,491円	710,200,608円
期首からの一部解約元本額	922,718,336円	591,650,018円
元本の内訳*		
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定型)	227,536,374円	251,824,690円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定成長型)	267,963,614円	285,623,175円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(成長型)	284,730,784円	291,410,971円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(積極型)	386,773,487円	389,230,394円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2020	93,337,753円	85,453,748円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2030	175,217,050円	186,774,570円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2040	224,446,545円	235,659,568円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定型)	39,564,038円	45,931,050円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定成長型)	103,764,588円	111,832,098円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(成長型)	70,501,307円	77,729,629円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(積極型)	86,221,571円	90,120,469円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤーファンド 2020	49,855,344円	48,724,390円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤーファンド 2030	70,454,808円	82,716,603円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤーファンド 2040	90,531,690円	106,418,188円
(合計)	2,170,898,953円	2,289,449,543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。	67,547,749円	469,308,754円

3	受益権の総数	2,170,898,953口	2,289,449,543口
4	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9689円 (9,689円)	0.7950円 (7,950円)

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区 分	（自平成26年8月15日 至平成27年8月14日）	（自平成27年8月15日 至平成28年8月15日）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成27年8月14日現在]	[平成28年8月15日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。	同 左
2 時価の算定方法	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。 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 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。	同 左 同 左 同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	[平成27年8月14日現在]	[平成28年8月15日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,817,357	18,484,140
合計	2,817,357	18,484,140

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

（単位：円）

コード	銘 柄 銘 柄 名	株式数	評 価 額		備 考
			単 価	金 額	
1605	国際石油開発帝石	7,500	846.20	6,346,500	
1801	大成建設	39,000	809.00	31,551,000	
1808	長谷工コーポレーション	25,800	1,039.00	26,806,200	
1928	積水ハウス	15,600	1,677.50	26,169,000	
1942	関電工	21,000	965.00	20,265,000	
2229	カルビー	3,600	4,475.00	16,110,000	
2269	明治ホールディングス	2,300	9,990.00	22,977,000	
2282	日本ハム	7,000	2,394.00	16,758,000	
2914	日本たばこ産業	4,300	4,043.00	17,384,900	
3402	東レ	19,000	959.50	18,230,500	
4042	東ソー	32,000	578.00	18,496,000	
4217	日立化成	4,700	2,059.00	9,677,300	
4452	花王	5,400	5,491.00	29,651,400	
4901	富士フイルムホールディングス	7,200	3,817.00	27,482,400	
7988	ニフコ	4,600	5,270.00	24,242,000	
4507	塩野義製薬	9,100	5,187.00	47,201,700	
4516	日本新薬	4,900	5,320.00	26,068,000	
4536	参天製薬	17,500	1,489.00	26,057,500	
5108	ブリヂストン	3,600	3,358.00	12,088,800	
5332	TOTO	2,200	3,915.00	8,613,000	

5333	日本碍子	5,000	2,277.00	11,385,000	
5334	日本特殊陶業	7,400	1,807.00	13,371,800	
5393	ニチアス	25,000	854.00	21,350,000	
5401	新日鐵住金	3,500	1,973.50	6,907,250	
5802	住友電気工業	6,200	1,403.50	8,701,700	
5929	三和ホールディングス	39,900	971.00	38,742,900	
5631	日本製鋼所	20,000	501.00	10,020,000	
6113	アマダホールディングス	17,100	1,062.00	18,160,200	
6273	S M C	700	28,610.00	20,027,000	
6287	サトーホールディングス	9,000	2,056.00	18,504,000	
6383	ダイフク	12,600	1,777.00	22,390,200	
6457	グローリー	6,500	3,240.00	21,060,000	
6465	ホシザキ	2,500	8,610.00	21,525,000	
6479	ミネベア	11,000	890.00	9,790,000	
6503	三菱電機	15,000	1,324.00	19,860,000	
6592	マブチモーター	4,600	5,240.00	24,104,000	
6594	日本電産	2,400	9,383.00	22,519,200	
6758	ソニー	9,100	3,300.00	30,030,000	
6869	シスメックス	3,600	6,800.00	24,480,000	
6952	カシオ計算機	12,000	1,412.00	16,944,000	
6981	村田製作所	1,900	13,105.00	24,899,500	
7276	小糸製作所	4,800	5,020.00	24,096,000	
7201	日産自動車	38,500	998.00	38,423,000	
7202	いすゞ自動車	21,400	1,236.00	26,450,400	
7259	アイシン精機	3,200	4,645.00	14,864,000	
7261	マツダ	8,300	1,574.50	13,068,350	
7270	富士重工業	4,900	3,781.00	18,526,900	
7747	朝日インテック	5,700	4,920.00	28,044,000	
7864	フジシールインターナショナル	6,100	3,860.00	23,546,000	
9020	東日本旅客鉄道	2,400	8,834.00	21,201,600	
9022	東海旅客鉄道	1,300	17,570.00	22,841,000	
9201	日本航空	5,000	3,131.00	15,655,000	
3626	T I S	3,700	2,622.00	9,701,400	
4768	大塚商会	4,800	4,665.00	22,392,000	
9432	日本電信電話	11,100	4,870.00	54,057,000	
9433	K D D I	16,400	3,255.00	53,382,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	3,300	5,340.00	17,622,000	
9719	S C S K	2,700	4,125.00	11,137,500	
3076	あい ホールディングス	9,100	2,317.00	21,084,700	
8058	三菱商事	23,400	2,046.00	47,876,400	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	5,400	4,400.00	23,760,000	
3391	ツルハホールディングス	2,200	11,440.00	25,168,000	
7453	良品計画	1,100	20,690.00	22,759,000	
9843	ニトリホールディングス	2,100	11,880.00	24,948,000	
9983	ファーストリテイリング	300	37,630.00	11,289,000	
7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	32,000	486.60	15,571,200	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	105,000	524.90	55,114,500	
8308	りそなホールディングス	44,100	425.90	18,782,190	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	8,000	3,362.00	26,896,000	
8604	野村ホールディングス	17,600	457.30	8,048,480	
8750	第一生命保険	13,400	1,385.00	18,559,000	
8766	東京海上ホールディングス	7,900	3,815.00	30,138,500	
8591	オリックス	16,400	1,449.00	23,763,600	
4666	パーク24	8,000	3,155.00	25,240,000	
8801	三井不動産	10,000	2,245.00	22,450,000	
8802	三菱地所	8,000	2,018.50	16,148,000	
8804	東京建物	17,000	1,279.00	21,743,000	
2371	カカクコム	14,200	1,852.00	26,298,400	
2413	エムスリー	6,600	3,255.00	21,483,000	
4661	オリエンタルランド	4,400	6,278.00	27,623,200	
4755	楽天	16,500	1,253.00	20,674,500	
	合計	967,600		1,807,374,770	

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「世界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。

(1) 貸借対照表

	[平成27年8月14日現在]	[平成28年8月15日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,904,688	3,044,731
コール・ローン	21,959,483	9,160,894
国債証券	746,753,094	562,725,546
未収利息	6,106,912	3,689,410
前払費用	2,568,179	263,613
流動資産合計	779,292,356	578,884,194
資産合計	779,292,356	578,884,194
負債の部		
流動負債		
未払利息		11
流動負債合計		11
負債合計		11
純資産の部		
元本等		
元本	1 289,508,656	248,673,026
剰余金		
剰余金又は欠損金()	489,783,700	330,211,157
元本等合計	779,292,356	578,884,183
純資産合計	779,292,356	578,884,183
負債純資産合計	779,292,356	578,884,194

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年2月8日から8月7日まで、および8月8日から翌年2月7日までであります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[平成27年8月14日現在]	[平成28年8月15日現在]
1 期首	平成26年8月15日	平成27年8月15日
期首元本額	274,144,518円	289,508,656円
期首からの追加設定元本額	83,840,362円	57,970,900円
期首からの一部解約元本額	68,476,224円	98,806,530円
元本の内訳*		
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定型)	46,930,617円	42,637,241円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定成長型)	37,434,992円	32,457,861円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(成長型)	33,900,875円	28,397,049円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(積極型)	23,236,961円	16,417,410円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2020	20,048,404円	14,137,290円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2030	29,159,249円	26,483,847円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2040	28,657,343円	25,102,906円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定型)	8,145,400円	7,788,229円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定成長型)	14,475,222円	12,712,218円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(成長型)	8,382,885円	7,580,332円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(積極型)	5,186,916円	3,805,622円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤーファンド 2020	10,644,241円	8,102,775円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤーファンド 2030	11,729,341円	11,720,650円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤーファンド 2040	11,576,210円	11,329,596円
(合計)	289,508,656円	248,673,026円

2 受益権の総数	289,508,656口	248,673,026口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6918円 (26,918円)	2.3279円 (23,279円)

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区 分	(自平成26年8月15日 至平成27年8月14日)	(自平成27年8月15日 至平成28年8月15日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成27年8月14日現在]	[平成28年8月15日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	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。 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 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。	同 左 同 左 同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	[平成27年8月14日現在]	[平成28年8月15日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,624,197	2,568,108
合計	2,624,197	2,568,108

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

通 貨			券面総額	評 価 額	備考
種 類	銘 柄				
アメリカドル					
国債証券	0.875 T-NOTE	171130	381,000.00	381,907.85	
	1.25 T-NOTE	191031	97,000.00	98,182.18	
	1.75 T-NOTE	230131	336,000.00	345,108.75	
	1.875 T-NOTE	200630	122,000.00	126,165.15	
	2.125 T-NOTE	250515	270,000.00	284,238.27	
	2.375 T-NOTE	240815	76,000.00	81,480.31	

	2.5 T-BOND 460515	54,000.00	57,130.30	
	2.75 T-BOND 420815	147,000.00	163,721.25	
	3.625 T-NOTE 210215	340,000.00	378,170.31	
	3.75 T-NOTE 181115	249,000.00	265,719.95	
	4.375 T-BOND 380215	156,000.00	223,055.62	
	5.5 T-BOND 280815	25,000.00	35,572.26	
	国債証券 小計	2,253,000.00	2,440,452.20 (247,632,684)	
アメリカドル 小計		2,253,000.00	2,440,452.20 (247,632,684)	
カナダドル				
国債証券	2.5 CAN GOVT 240601	130,000.00	146,346.20	
	国債証券 小計	130,000.00	146,346.20 (11,445,736)	
カナダドル 小計		130,000.00	146,346.20 (11,445,736)	
オーストラリアドル				
国債証券	3.25 AUST GOVT 250421	125,000.00	138,728.75	
	5.25 AUST GOVT 190315	4,000.00	4,386.20	
	国債証券 小計	129,000.00	143,114.95 (11,099,995)	
オーストラリアドル 小計		129,000.00	143,114.95 (11,099,995)	
イギリスポンド				
国債証券	1.25 GILT 180722	34,000.00	34,731.00	
	2.75 GILT 240907	25,000.00	29,636.25	
	3.75 GILT 200907	33,000.00	37,918.65	
	4.25 GILT 271207	24,000.00	33,170.40	
	4.25 GILT 360307	63,000.00	97,794.90	
	4.25 GILT 551207	36,000.00	71,818.20	
	国債証券 小計	215,000.00	305,069.40 (39,964,091)	
イギリスポンド 小計		215,000.00	305,069.40 (39,964,091)	
スイスフラン				
国債証券	4 SWISS GOVT 280408	13,000.00	19,947.20	
	国債証券 小計	13,000.00	19,947.20 (2,074,708)	
スイスフラン 小計		13,000.00	19,947.20 (2,074,708)	
シンガポールドル				
国債証券	3.125SINGAPOREGOVT 220901	28,000.00	30,772.00	
	国債証券 小計	28,000.00	30,772.00 (2,317,747)	
シンガポールドル 小計		28,000.00	30,772.00 (2,317,747)	
マレーシアリングギット				
国債証券	4.048 MALAYSIA 210930	84,000.00	86,843.40	
	国債証券 小計	84,000.00	86,843.40 (2,183,243)	
マレーシアリングギット 小計		84,000.00	86,843.40 (2,183,243)	
スウェーデンクローネ				
国債証券	1.5 SWD GOVT 231113	195,000.00	220,628.85	
	国債証券 小計	195,000.00	220,628.85 (2,643,133)	
スウェーデンクローネ 小計		195,000.00	220,628.85 (2,643,133)	
ノルウェークローネ				
国債証券	3.75 NORWE GOVT 210525	121,000.00	138,484.50	
	国債証券 小計	121,000.00	138,484.50 (1,706,129)	
ノルウェークローネ 小計		121,000.00	138,484.50 (1,706,129)	
デンマーククローネ				
国債証券	1.75 DMK GOVT 251115	214,000.00	247,812.00	
	国債証券 小計	214,000.00	247,812.00 (3,769,220)	
デンマーククローネ 小計		214,000.00	247,812.00 (3,769,220)	
メキシコペソ				

国債証券	8 MEXICAN BONOS 231207	804,000.00	915,040.44	
	国債証券 小計	804,000.00	915,040.44 (5,087,624)	
メキシコペソ 小計		804,000.00	915,040.44 (5,087,624)	
ポーランドズロチ				
国債証券	2 POLAND 210425	124,000.00	124,254.20	
	国債証券 小計	124,000.00	124,254.20 (3,292,736)	
ポーランドズロチ 小計		124,000.00	124,254.20 (3,292,736)	
ユーロ				
国債証券	0.375 FINNISH GOV 200915	103,000.00	106,828.51	
	0.5 O.A.T 250525	211,000.00	220,841.04	
	0.8 BEL GOVT 250622	165,000.00	176,906.40	
	1 O.A.T 181125	50,000.00	51,813.00	
	1.5 BUND 240515	83,000.00	95,443.36	
	2 IRISH GOVT 450218	49,000.00	59,623.20	
	2.25 BUND 210904	61,000.00	69,847.44	
	2.25 NETH GOVT 220715	43,000.00	49,987.07	
	2.4 IRISH GOVT 300515	40,000.00	49,268.00	
	3.75 BEL GOVT 200928	23,000.00	27,140.92	
	3.75 O.A.T 191025	27,000.00	30,739.50	
	3.75 O.A.T 210425	93,000.00	111,638.13	
	4 O.A.T 550425	70,000.00	134,178.10	
	4.25 BEL GOVT 220928	84,000.00	108,369.24	
	4.25 BEL GOVT 410328	61,000.00	108,770.93	
	4.25 BUND 390704	58,000.00	108,990.12	
	4.35 AUSTRIA GOVT 190315	80,000.00	90,206.40	
	4.5 IRISH GOVT 181018	220,000.00	243,562.00	
	4.75 BUND 280704	40,000.00	63,302.00	
	5.5 O.A.T 290425	73,000.00	120,721.56	
国債証券 小計		1,634,000.00	2,028,176.92 (229,508,500)	
ユーロ 小計		1,634,000.00	2,028,176.92 (229,508,500)	
合 計			562,725,546 (562,725,546)	

(注1) 通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 12銘柄	100.00%	44.01%
カナダドル	国債証券 1銘柄	100.00%	2.03%
オーストラリアドル	国債証券 2銘柄	100.00%	1.97%
イギリスポンド	国債証券 6銘柄	100.00%	7.10%
スイスフラン	国債証券 1銘柄	100.00%	0.37%
シンガポールドル	国債証券 1銘柄	100.00%	0.41%
マレーシアリングgit	国債証券 1銘柄	100.00%	0.39%
スウェーデンクローネ	国債証券 1銘柄	100.00%	0.47%
ノルウェークローネ	国債証券 1銘柄	100.00%	0.30%
デンマーククローネ	国債証券 1銘柄	100.00%	0.67%
メキシコペソ	国債証券 1銘柄	100.00%	0.90%
ポーランドズロチ	国債証券 1銘柄	100.00%	0.59%
ユーロ	国債証券 20銘柄	100.00%	40.79%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

「世界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。

(1) 貸借対照表

	[平成27年8月14日現在]	[平成28年8月15日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金		303,287
コール・ローン	32,318,878	11,724,338
株式	1,145,014,629	966,465,406
未収入金	747,620	46,645,188
未収配当金	810,651	392,595
未収利息	53	
流動資産合計	1,178,891,831	1,025,530,814
資産合計	1,178,891,831	1,025,530,814
負債の部		
流動負債		
未払金		7,032,125
未払利息		14
流動負債合計		7,032,139
負債合計		7,032,139
純資産の部		
元本等		
元本	1	575,770,925
剰余金		586,757,797
剰余金又は欠損金()	603,120,906	431,740,878
元本等合計	1,178,891,831	1,018,498,675
純資産合計	1,178,891,831	1,018,498,675
負債純資産合計	1,178,891,831	1,025,530,814

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年2月8日から8月7日まで、および8月8日から翌年2月7日までであります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[平成27年8月14日現在]	[平成28年8月15日現在]
1 期首	平成26年8月15日	平成27年8月15日
期首元本額	704,059,180円	575,770,925円
期首からの追加設定元本額	111,350,535円	237,251,469円
期首からの一部解約元本額	239,638,790円	226,264,597円
元本の内訳*		
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定型)	56,928,829円	59,265,325円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定成長型)	65,903,286円	67,486,763円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(成長型)	78,479,653円	78,853,835円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(積極型)	116,746,151円	115,271,180円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2020	23,266,290円	19,868,410円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2030	41,652,607円	44,138,224円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2040	58,986,384円	59,281,360円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定型)	9,872,231円	10,769,892円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定成長型)	25,487,172円	26,429,704円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(成長型)	19,425,602円	21,029,054円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(積極型)	26,028,342円	26,690,886円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤーファンド 2020	12,432,849円	11,359,701円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤーファンド 2030	16,751,308円	19,535,748円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤーファンド 2040	23,810,221円	26,777,715円

(合計)	575,770,925円	586,757,797円
2 受益権の総数	575,770,925口	586,757,797口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0475円 (20,475円)	1.7358円 (17,358円)

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	(自平成26年8月15日 至平成27年8月14日)	(自平成27年8月15日 至平成28年8月15日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。 当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成27年8月14日現在]	[平成28年8月15日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2 時価の算定方法	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。 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 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。	同左 同左 同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[平成27年8月14日現在]	[平成28年8月15日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	7,489,684	5,779,835
合計	7,489,684	5,779,835

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位:円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル					
	ABIOMED INC	1,205	123.690000	149,046.45	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	928	74.080000	68,746.24	
	ALPHABET INC-CL A	156	807.050000	125,899.80	

ALPHABET INC-CL C	235	783.220000	184,056.70	
AMAZON.COM INC	560	772.560000	432,633.60	
AMERICAN EXPRESS CO	1,752	65.380000	114,545.76	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	661	97.970000	64,758.17	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,460	69.680000	101,732.80	
CARMAX INC	2,155	59.560000	128,351.80	
CELGENE CORP	663	113.390000	75,177.57	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	175	397.330000	69,532.75	
COLGATE-PALMOLIVE CO	1,448	74.970000	108,556.56	
DONALDSON CO INC	2,466	36.670000	90,428.22	
ELLIE MAE INC	1,091	97.940000	106,852.54	
EOG RESOURCES INC	1,168	91.200000	106,521.60	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	1,074	93.100000	99,989.40	
FACEBOOK INC-A	1,717	124.880000	214,418.96	
FASTENAL CO	2,228	43.440000	96,784.32	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	4,110	72.050000	296,125.50	
GENOMIC HEALTH INC	618	27.000000	16,686.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	737	163.250000	120,315.25	
GRUBHUB INC	4,024	38.530000	155,044.72	
HARLEY-DAVIDSON INC	2,576	53.720000	138,382.72	
ILLUMINA INC	1,298	166.990000	216,753.02	
INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A	2,528	35.530000	89,819.84	
JUNO THERAPEUTICS INC	2,451	32.660000	80,049.66	
LINCOLN ELECTRIC HOLDINGS	1,319	64.210000	84,692.99	
M & T BANK CORP	1,270	116.310000	147,713.70	
MARKEL CORP	198	923.980000	182,948.04	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,243	162.220000	201,639.46	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,026	196.460000	201,567.96	
MASTERCARD INC-CLASS A	1,358	96.120000	130,530.96	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	168	399.930000	67,188.24	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	849	60.510000	51,372.99	
MOODY'S CORP	913	103.460000	94,458.98	
NETFLIX INC	844	96.590000	81,521.96	
NOW INC	3,903	20.470000	79,894.41	
NVIDIA CORP	1,450	63.040000	91,408.00	
PACCAR INC	1,480	57.710000	85,410.80	
PAYPAL HOLDINGS INC	1,478	38.510000	56,917.78	
PRAXAIR INC	688	116.770000	80,337.76	
RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR	874	72.550000	63,408.70	
SCHLUMBERGER LTD	1,169	81.200000	94,922.80	
SEATTLE GENETICS INC	877	46.860000	41,096.22	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	208	295.810000	61,528.48	
STERICYCLE INC	688	87.020000	59,869.76	
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	2,008	53.850000	108,130.80	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	4,911	30.770000	151,111.47	
TESLA MOTORS INC	772	225.610000	174,170.92	
TIFFANY & CO	1,324	67.310000	89,118.44	
TJX COMPANIES INC	915	82.870000	75,826.05	
TRIPADVISOR INC	2,126	61.700000	131,174.20	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,005	94.920000	95,394.60	
VERISK ANALYTICS INC	1,415	81.420000	115,209.30	
WATERS CORP	1,094	158.250000	173,125.50	
WATSCO INC	986	144.410000	142,388.26	
WAYFAIR INC- CLASS A	2,654	38.990000	103,479.46	
アメリカドル 小計	80,697		6,768,768.94 (686,826,984)	
オーストラリアドル				
ANSELL LTD	1,217	19.670000	23,938.39	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	4,843	15.490000	75,018.07	
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,696	26.560000	45,045.76	
BRAMBLES LTD	3,878	13.200000	51,189.60	
CHALLENGER LTD	8,892	9.190000	81,717.48	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	732	76.910000	56,298.12	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	2,367	21.330000	50,488.11	
MESOBLAST LTD	12,839	1.615000	20,734.98	
SEEK LTD	2,470	16.140000	39,865.80	
WOOLWORTHS LTD	1,320	23.400000	30,888.00	

オーストラリアドル 小計	40,254		475,184.31 (36,855,295)
イギリスポンド			
ABCAM PLC	4,986	7.380000	36,796.68
BURBERRY GROUP PLC	2,418	13.560000	32,788.08
COCA-COLA HBC AG-DI	2,385	17.200000	41,022.00
DOMINO'S PIZZA GROUP PLC	7,334	3.760000	27,575.84
EXPERIAN PLC	1,849	15.340000	28,363.66
HARGREAVES LANSDOWN PLC	2,295	13.400000	30,753.00
IMAGINATION TECH GROUP PLC	4,422	2.005000	8,866.11
JOHNSON MATTHEY PLC	749	33.590000	25,158.91
JUST EAT PLC	1,589	5.840000	9,279.76
OCADO GROUP PLC	5,541	2.896000	16,046.73
OXFORD INSTRUMENTS PLC	1,746	7.270000	12,693.42
PAGEGROUP PLC	2,908	3.674000	10,683.99
PRUDENTIAL PLC	1,880	14.265000	26,818.20
REGUS PLC	4,502	3.132000	14,100.26
RENISHAW PLC	1,911	26.880000	51,367.68
RIGHTMOVE PLC	218	41.780000	9,108.04
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	2,835	7.995000	22,665.82
ROTORK PLC	9,862	2.052000	20,236.82
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	615	44.440000	27,330.60
ST JAMES'S PLACE PLC	5,038	9.790000	49,322.02
WEIR GROUP PLC/THE	436	15.660000	6,827.76
XAAR PLC	2,002	5.000000	10,010.00
イギリスポンド 小計	67,521		517,815.38 (67,833,814)
スイスフラン			
NESTLE SA-REG	1,305	79.800000	104,139.00
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	428	196.800000	84,230.40
スイスフラン 小計	1,733		188,369.40 (19,592,301)
香港ドル			
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	9,000	26.400000	237,600.00
GLOBAL BRANDS GROUP HOLDING	126,800	0.750000	95,100.00
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,100	197.100000	216,810.00
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	10,500	33.700000	353,850.00
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,000	31.750000	444,500.00
香港ドル 小計	161,400		1,347,860.00 (17,630,008)
スウェーデンクローネ			
ALFA LAVAL AB	3,227	137.100000	442,421.70
ATLAS COPCO AB-A SHS	4,266	244.400000	1,042,610.40
HEXPOL AB	8,231	80.900000	665,887.90
INVESTOR AB-B SHS	3,056	297.400000	908,854.40
KINNEVIK AB - B	1,542	214.200000	330,296.40
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	7,756	75.700000	587,129.20
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	9,176	107.900000	990,090.40
VOLVO AB-B SHS	3,577	89.800000	321,214.60
スウェーデンクローネ 小計	40,831		5,288,505.00 (63,356,289)
デンマーククローネ			
CARLSBERG AS-B	725	667.000000	483,575.00
JYSKE BANK-REG	1,254	285.600000	358,142.40
デンマーククローネ 小計	1,979		841,717.40 (12,802,521)
ユーロ			
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,843	33.385000	61,528.55
COLRUYT SA	878	50.130000	44,014.14
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	8,180	5.630000	46,053.40
ELRINGKLINGER AG	1,718	16.545000	28,424.31
EXOR SPA	1,259	36.850000	46,394.15
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	813	78.210000	63,584.73
KONECRANES OYJ	1,795	26.530000	47,621.35
LEGRAND SA	841	53.360000	44,875.76
L'OREAL	334	175.750000	58,700.50
TOTAL SA	1,069	43.350000	46,341.15
ZALANDO SE	1,539	36.740000	56,542.86

ユーロ 小計	20,269		544,080.90 (61,568,194)	
合計	414,684		966,465,406 (966,465,406)	

(注1) 通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 57銘柄	100.00%	71.07%
オーストラリアドル	株式 10銘柄	100.00%	3.81%
イギリスポンド	株式 22銘柄	100.00%	7.02%
スイスフラン	株式 2銘柄	100.00%	2.03%
香港ドル	株式 5銘柄	100.00%	1.82%
スウェーデンクローネ	株式 8銘柄	100.00%	6.56%
デンマーククローネ	株式 2銘柄	100.00%	1.32%
ユーロ	株式 11銘柄	100.00%	6.37%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】
【純資産額計算書】

平成28年8月31日現在
(単位：円)

資産総額	291,840,897
負債総額	191,598
純資産総額(-)	291,649,299
発行済口数	211,288,742 口
1口当たり純資産価額(/)	1.3803 (1万口当たり 13,803)

<参考>

「国内債券マザーファンド」の現況
純資産額計算書

平成28年8月31日現在
(単位：円)

資産総額	2,688,180,598
負債総額	49
純資産総額(-)	2,688,180,549
発行済口数	1,890,276,580 口
1口当たり純資産価額(/)	1.4221 (1万口当たり 14,221)

<参考>

「国内株式マザーファンド」の現況
純資産額計算書

平成28年8月31日現在
(単位：円)

資産総額	1,819,101,774
負債総額	29
純資産総額(-)	1,819,101,745
発行済口数	2,305,196,925 口
1口当たり純資産価額(/)	0.7891 (1万口当たり 7,891)

<参考>

「世界債券マザーファンド」の現況
純資産額計算書

平成28年8月31日現在
(単位：円)

資産総額	589,904,622
負債総額	16
純資産総額(-)	589,904,606
発行済口数	250,040,807 口
1口当たり純資産価額(/)	2.3592 (1万口当たり 23,592)

<参考>

「世界株式マザーファンド」の現況
純資産額計算書

平成28年8月31日現在
(単位：円)

資産総額	998,276,883
負債総額	1,204,049
純資産総額(-)	997,072,834
発行済口数	563,599,484 口
1口当たり純資産価額(/)	1.7691 (1万口当たり 17,691)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

したがって、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

（2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

（4）受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（5）受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

（6）受益権の再分割

委託会社は、受託会社と合意のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

（7）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、解約請求の受付け、解約代金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第二部【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】

報告書代替書面における「委託会社等の概況」の記載のとおりです。

報告書代替書面については、（<http://www.am.mufg.jp/corp/profile/accounting.html>）でもご覧いただけます。

2【事業の内容及び営業の概況】

報告書代替書面における「事業の内容及び営業の概況」の記載のとおりです。

3【委託会社等の経理状況】

報告書代替書面における「委託会社等の経理状況」の「冒頭書面」の記載のとおりです。

（1）【貸借対照表】

報告書代替書面における「委託会社等の経理状況」の（1）「貸借対照表」の記載のとおりです。

（2）【損益計算書】

報告書代替書面における「委託会社等の経理状況」の（2）「損益計算書」の記載のとおりです。

（3）【株主資本等変動計算書】

報告書代替書面における「委託会社等の経理状況」の（3）「株主資本等変動計算書」の記載のとおりです。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

通常の実行の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。 ）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。 ）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記 に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

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

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（平成28年3月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (平成28年3月末現在)	事業の内容
株式会社鹿児島銀行	18,130 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。
株式会社SBI証券	47,937 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。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社：ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

(2) 販売会社：ファンドの募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。

3【資本関係】

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28年8月末現在）

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の51.0%（107,855株）を所有しています。

（注）関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

第3【参考情報】

1 当計算期間において、次の書類を関東財務局長に提出しております。

平成28年5月13日 半期報告書、有価証券届出書の訂正届出書

平成27年11月13日 有価証券報告書、有価証券届出書

2 その他

- (1) 目論見書の表紙にロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、またファンドの形態、申込みに係る事項などを記載することがあります。
- (2) 投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。
- (3) 目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- ・当ファンドの受益権の価額は、株式・公社債等の有価証券市場の相場変動、組入有価証券の発行者の信用状況の変化、為替市場の相場変動等の影響により変動し、下落する場合があります。したがって、投資家のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。
 - ・当ファンドは、一定の運用成果を保証するものではありません。
 - ・運用により信託財産に生じた損益はすべて投資家のみなさまに帰属します。
 - ・投資信託は、預金等や保険契約とは異なり、預金保険機構、貯金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
 - ・金融商品取引業者以外の金融機関は、投資者保護基金に加入しておりません。
 - ・当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
- (4) 目論見書は電磁的方法により提供されるほか、インターネット、電子媒体等に掲載されることがあります。
- (5) 投信評価機関、投信評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。
- (6) 目論見書は「投資信託説明書」を別称として使用します。
- (7) 目論見書に委託会社のホームページアドレスのほか、モバイルサイトのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等を含みます。）等を掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨のご案内を記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成28年9月21日

三菱UFJ国際投信株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 柴 毅 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（安定成長型）の平成27年8月15日から平成28年8月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表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 <DC>ライフ・バランスファンド（安定成長型）の平成28年8月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況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

三菱UFJ国際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、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。